

“第一届金融与计算论坛”在北京召开

文章来源：计算机网络信息中心

发布时间：2014-06-24

【字号：小 中 大】

6月21日至22日，“第一届金融与计算论坛”在位于怀柔科教园的中国科学院北京超级云计算中心召开。来自中国人民大学信息学院、中央财经大学金融学院、中央财经大学统计与数学学院、华东师范大学金融与统计学院、北京联合大学应用文理学院、中国科学院计算机网络信息中心等科研院所，以及北京盈赛福投资管理有限公司、北京凯信投资管理有限公司、信达投资有限公司、中国人民建设银行北京分行等30余名代表参加了本次论坛。

本次论坛由中央财经大学统计与数学学院主办，中科院网络中心超级计算中心协办，得到国家自然科学基金项目“稳健投资组合选择的并行最优化算法研究与实现”资助。

在论坛开始，中央财经大学统计与数学学院教授胡永宏博士首先回顾了基于“计算金融虚拟实验室”开展的合作研究历程和体会，他指出，在样本数量、变量维数、数据高频等多个特性等方面，金融数据当之无愧堪称大数据。一方面，金融数据处理引发对方法的需求，如对分析方法、计算方法、并行计算的需求，以及对工具的需求，如对计算机、超级计算机的需求；另一方面，理论方法与工具也渴望更好地解决实际问题，由此催生金融与计算的深度交叉和融合研究，这也是举办“金融与计算论坛”的缘由；最后，胡永宏谈到，希望结合国家自然科学基金项目研究，在大家的共同努力下，能将“金融与计算论坛”越办越好，越办水平越高，逐渐形成“金融与计算”交叉研究的一个品牌，促进金融与计算交叉学科发展。

中国人民大学信息学院教授许作良博士在致辞中指出，对于一些复杂的金融问题会产生海量的金融数据，理论分析往往无能为力，而类似自然科学一样的实验方法又难以进行，金融的发展呼唤着新的研究方法出现。近些年来，计算机处理问题能力的增强为计算成为金融研究的手段提供了可能。金融计量方法与计算技术、计算方法的有效结合为处理金融大数据尤其是高维高频数据，研究和发现金融现象的数量规律提供了有力工具。计算机的飞速发展已经把计算推向金融科研和金融实务的前沿。现在，理论分析和计算已经成为了当今金融活动的主要方式。今天，计算在金融研究和金融实业中已几乎无处不在，对金融的发展起着举足轻重的作用。

中央财经大学金融学院副教授李俊峰博士在致辞中表示，“金融与计算论坛”在金融研究和计算机应用以及金融实业界之间搭起了桥梁，可望缩短理论研究和实际应用之间的距离。例如，在金融研究中，研究高频金融数据特征复杂统计模型已经在理论研究中做到非常前沿的讨论，但是由于计算的复杂性以及实现的硬件和软件要求，这些研究成果的应用往往严重滞后，不能被直接转化为生产力。

华东师范大学金融与统计学院副教授贺思辉博士在致辞中说，从名称就可以看出，论坛发起者在金融和计算两个方面有着深入的思考和一定程度的研究实践。金融问题与统计技术的结合，其中的瓶颈问题之一就是，如何将统计理论与金融理论及金融市场实践之间的联系，通过数值计算，来建立创新性的知识发现和技术路径；特别是大数据背景下的金融风险理论管理理论与实践，更需要计算技术的创新性发展。本次是第一届金融与计算论坛，衷心希望论坛能持续举办，并为中国的现代金融创新管理实践贡献本论坛的才艺和智慧。

来自北京盈赛福投资管理有限公司研究员刘勤博士，北京凯信投资管理有限公司投资分析师常红旭先生，北京联合大学应用文理学院副教授马青华博士，中央财经大学统计与数学学院副教授李丰博士、刘玉涛博士，网络中心副研究员王彦桐博士以及研究生姚鹏辉分别作了学术报告，内容包括高性能计算在金融市场的应用、金融稳健投资组合优化问题、金融数据的贝叶斯建模、金融反问题的计算方法、信用风险度量、亚式期权定价的并行实现以及生活中的高性能计算等。中央财经大学统计与数学学院副教授苏治博士和网络中心超级计算中心副研究员王珏博士主持了学术报告。

论坛讨论环节，气氛活跃。中央财经大学经济学院副教授周战强博士在发言中特别强调，金融理论与量化

分析应该相互融合；中央财经大学统计与数学学院副教授贾尚晖博士在发言中提出，计算方法研究可以更好地服务于金融实践。与会者表示，本次论坛为金融研究和计算学界及金融投资管理业界提供了一个难得的交流和学习机会，使大家对金融中高频交易数据计算问题有了更清晰的认识，对并行计算有了更深入的理解，参观网络中心怀柔分中心先进的信息化基础设施印象深刻，特别是超级计算机“元”令人振奋。与会者认为，此次论坛为金融学界和金融业界在数据源、软件工具和理论研究等方面开展深入合作搭建了桥梁，可望通过论坛建立不同学科间的深度合作研究。



“第一届金融与计算论坛”在北京召开

[打印本页](#)

[关闭本页](#)