

二〇一九年度工作报告

在过去的 2019 年中，成都正福金融工程应用研究院在成都市政府的支持下、在成都民进市委会的支持下、在高新区政府的支持下、在社会各界的帮助下、在全体同仁的齐心协力辛勤工作下取得了巨大的进步！在研究院各位职工的共同努力下，开展了系列职能工作，实现了研究院预定的工作目标，进一步提升了研究院在业内的影响力，为推动金融工程学技术的深入研究和成果应用转化做出了一定的贡献。

在过去一年的工作中，研究院遵守各项法律法规，各项内设机构、职工信息认真履行备案登记手续，严格遵守非营利机构财务制度，按照章程的要求在许可的业务范围内开展工作。

在过去的 2019 年，研究院积极履行公益事业工作，在以下几个方面都取得了巨大的进步：

一、科研相关工作取得进步：

研究院的科研工作取得长足发展。利用人工智能技术，对拥有巨量大数据的 A 股市场金融大数据开展了研究工作，研究院在今年完成了“智能投顾项目”二期工程，对 A 股市场的风险管理模型得到质的飞跃。实现了研究院内部科研服务器集群的构建，建立完善了研究院内部实习生学习和内部科研两层防火墙的架构，实施了科研人员外网异地两层 VPN 隧道连接应用远程服务器的工作，增加了几十个“金字塔决策交易系统”的专业版科研账号，研究院已经完善了科研物理

硬件构架、互联网环境安全防护到科研软件系统服务的全方位的基础建设，后续将为研究院的技术进步提供强有力的支撑。

二、研究成果的同业交流和公益性分享更加有序：

随着研究院官网：[HTTP://WWW.CZIFE.ORG](http://www.czife.org)、微信公众号：“正福金融研究院”的建设，研究院的社会影响力不断提升。研究院在成都市各级政府的支持下，研究院的“社会实践基地”运行良好，同行、同业的业务交流与日俱增，研究院接待了前来拜访的证券、期货机构 14 个，资管机构 8 个，交易爱好者若干，今年研究院实验室新增 12 个，参加行业交流会议 8 个。研究院在四川证监局投资者保护处的工作指导下，今年还与“华西证券国家级投资者教育基地”达成战略合作关系，受邀担任了“全国大学生金融精英辩论赛”的评委。为宽容俱乐部开展了业务讲座。受邀参加了“四川省金融科技协会”举办的第二届“金融科技发展峰会”，受邀“天府新区对冲基金学会”会员俱乐部成立挂牌典礼作为嘉宾发言讲话。研究院也受邀参加证券期货协会的“走进上市公司”的活动。

研究院的公益性知识分享工作持续完善。研究院多个实验室在开展知识分享的工作中，工作方法不断完善，合规意识显著增强，今年公益分享研究成果累计服务人次超过 2000 人次，吸收的机构 and 个人的慈善社会捐款大力地支撑了研究院各项工作的开展，捐赠项目的信息透明和信息传递工作明显优化，慈善捐款使用和管理更加规范完善，研究院内部管理和监督工作体系更加完善，下属机构的业务系统性得

到提升。

三、产学研转化工作运行良好：

理论研究的大数据风控模型开始小试工作的开展，已经启动的试验基金运行良好。研究院实验室已经启动的试验基金运行良好，今年没有任何一支试验基金触及风控线，启用的模型测试的模型大多验证良好。今年全球经济遇到前所未有的困难，市场环境较差，全球市场黑天鹅事件不断，突发风险倍出，众多资管机构出现大面积亏损和净值曲线大幅回撤的情况下，研究院运行的每支试验基金都能保持净值曲线的相对稳定，展现了实验室专家老师们对金融大数据研究已经能够很好地通过特征抽取捕捉到可能的风险，展现出了人工智能系统模型高超的风险管理能力，提升了研究院的专业水平影响力。

四、金融科技人才培养工作继续深化：

研究院公益性人才培养工作取得长足进步，研究院今年接收到的实习申请 221 人，研究院审核通过利用公益捐款支持参加专业研究实习的同学 72 人，实习生主要是分布于国内外各高校的金融学、金融工程、金融数学、统计学、应用数学、计算机等专业的本科、硕士、博士。研究院后续也会研究如何为在职的人员提供金融工程技术应用研究学习的机会。

五、研究院内部管理制度不断建设。

研究院坚持每周工作例会的方式召开内部工作指导会议，加强内部管理，定期对下属实验室的工作开展状况进行审核考评，加强对下

属实验室各项工作的指导，协助实验室开展科研工作和知识分享工作，树立服务社会大众的价值观，不断推动金融科技的进步发展。

六：围绕中心工作，加强政治学习，不断提高职工队伍素质

研究院不定期开展政治学习，围绕习近平新时代中国特色社会主义思想核心价值观，认真学习“四个自信”、坚持“四个意识”，做到“两个维护”，努力发挥科研院所的特点，积极参与参政议政工作，郑刚副院长被选举为民进高新总支副主委，研究院将继续围绕成都市政府的中心工作目标，发挥科研优势，为新经济的发展献策献力。

研究院在高新区财政金融局的支持下，位于盈创动力大厦的社会实践基地运行良好，公益性活动平台不断完善，研究院各项工作透明度不断提升。在过去的一年的工作中，研究院建立并不断完善官网和微信公众号，定时定期为社会大众分享研究院最新科研成果，公示研究院参加的公益性研讨会议，展示研究院各金融工程实验室开展的科学研究方向，公开研究院内部管理制度和流程，极大地提高研究院的公益性科研机构的影响力和信誉度。

成都正福金融工程应用研究院

二〇一九年十二月