二〇二一年度工作报告

在过去的 2021 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 2021 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，对 A 股市场的风险管理模型得到质的飞跃。2021 年研究院新增研究成果：“纳什均衡风险管理模型”“A 股市场风险指数动态管理系数模型”等。

二、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。产学研工作开始落地实践实施，研究成果“A股智能投顾系统”经过知识产权评估后作为股本投入到产业化的“成都子尹金融科技有限公司”、同时“成都正福智能投资有限公司”也已经提交申请，等待成都高新区财政金融局的批复。

三、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，研究院成立以来，已连续4年为全球各大高校学子提供公益性金融工程实习项目。到目前为止研究院已收到880多份来自海内外高校在校大学生的实习申请，其中已有173人在研究院完成学习实践工作，完成实习的同学中也不乏来自海外诸多著名高校，如新南威尔士大学、澳大利亚国立大学、巴黎高等商学院、英属哥伦比亚大学、南加州大学等；更多的同学来自国内各大高校，如四川大学、西南财经大学、电子科技大学、西南交通大学、江西财经大学、中国人民大学、北京工商大学、武汉大学、香港城市大学、香港浸会大学等金融学、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。正福金融研究院一直秉承教书育人的理念，积极协助优秀实习生提高学术水平，多年持续向全球各大名校推荐优秀实习生继续深造的机会，郑刚副院长为众多同学提供推荐函。研

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。

四、党支部成立，发挥党建引领作用。

在中国共产党建党 100 周年之际，成都正福金融工程应用研究院党支部正式成立。研究院积极完善党支部组织建设，围绕市、区政府中心工作，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，认真学习“四个自信”、坚持“四个意识”，做到“两个维护”。积极参与到社会治理建设，走进街道社区发挥党建作用。

五、统战工作成为新的亮点。

研究院现有民进会员三名，致公党党员两名。研究院努力发挥科研院所的高智专业特点，积极参与参政议政工作，郑刚副院长作为民进高新总支副主委，在研究院的“金融工程实习生”项目实施工作中发现学校教育与学生就业之间出现脱节的问题，立刻组织专家队伍开展深入的调研工作，撰写了《关于实施大学生专项人才实训工程的建议》，该建议得到成都民进市委会的高度评价和认可，建议被纳入《中国民主促进会成都市第十一届委员会（2017-2021）调研成果选集》。积极承担民主党派的参政议政职责，围绕高新区管委会的中心工作任务组织会内专家开展《探索发展离岸贸易增强高新区全球资源配置能力的思考和研究》课题调研，为高新区管委会的产业结构的制定和工作决策做出了参政党应有的贡献。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。

六、公益事业的社会影响力大幅提升。

公益活动“金融工程知识”进校园得到民进中央官网的转载和肯定。研究院将“金融工程知识”送进成都七中校园，为即将进入大学面临职业规划的学子们打开一个了解现代金融行业的窗口，帮助学生正确理解这个行业在经济生活中的地位，有助于学子们对于大学专业的选择。研究院向成都七中捐赠 30 套共计价值 150 万元的金融大数据智能分析系统用于项目的开展。该项目对于有志于在金融科技相关行业发展的同学，加强了对人工智能技术在金融大数据分析中应用的深度了解。此公益项目的开展，得到了成都七中师生和易国栋校长的充分肯定。研究院将总结的工作经验，于 2022 年计划邀请澳新银行相关专家领导为七中学子开展讲座，普及行业知识；邀请四川大学、西南财经大学等高校博导为七中学子传授学科知识；同时开始理论实践类课程，从基础的编程到策略开发、模拟、优化、仿真和实盘交易连接等环节，全方位培养学生金融风险意识、风险度量和解决方案设计的能力，学习如何理论联系实际，通过应用场景的参与增强对基础学科学习的动力。研究院将再接再厉，努力将“送金融工程知识进校园”的公益活动做成品牌。

成都正福金融工程应用研究院

二〇二一年十二月