

统计与数据科学学院2024年度金融数据分析实验室

泰隆银行奖教金结果公示

为了表彰对过去一年中为金融数据分析实验室辛勤付出、贡献卓越的团队成员，激励和支持大家积极参与金融数据分析研究与应用工作，旨在全面提升研究的质量与水平，并进一步强化应用研究的深入发展。激励相关科研人员积极参与金融数据分析课题研究，提高研究水平和质量，同时增强实验室的学术影响力和竞争力，进一步推动实验室的发展。

根据《统计与数据科学学院泰隆银行奖教金使用办法》等文件规定，泰隆银行奖教金奖项设置如下：

(1) 一等奖：设立 2 个一等奖，每个奖项奖金为 5 万，主要奖励成果选题为学科前沿或实践热点、难点具有开创性，在金融数据分析领域提出创新性的理论或观点学术价值高、应用价值大；

(2) 二等奖：设立 4 个二等奖，每个奖项奖金为 2 万，主要奖励成果选题为学科前沿或实践热点、难点，提出的观点或结论有一定创新性学术价值较高、应用价值较大。

2024 年度泰隆银行奖教金申报于 9 月 1 日启动，相关科研人员在规定时间内提交成果申请，实验室组织专家对申报的成果进行初步评审，筛选出符合评审标准的一等奖和二等奖，实验室学术委员会对初步评审通过的成果进行终审评审，并最终确定一等奖和二等奖的获奖名单。

根据《统计与数据科学学院泰隆银行奖教金使用办法》等文件规定，经学院2024年第10次党政联席会审定通过，决定对2024年度金融数据分析实验室泰隆银行奖教金获奖情况予以公示如下：

序号	奖项	申报团队	申报成果
1	一等奖	冯凌秉	提交的项目《基于机器学习的金融市场风险预测与解释》，该项目包含三篇论文和两项课题。项目充分利用机器学习技术研究了金融市场波动率风险的预测和解释问题。研究成果中提出的预测模型显著提高了金融市场波动率预测的精度，相关方法可以广泛应用于股票市场、能源期货市场、贵金属市场和加密货币市场等。系列成果还有助于改进相关金融市场的投资策略和收益管理，通过对波动率的精准预测，投资者可以更好地管理风险和优化投资组合，实现收益最大化。同时，项目成果将有助于提高金融机构的风险管理能力，为金融机构提供了全面的风险评估框架，结合机器学习模型的可解释性工具帮助机构深入理解波动率的影响因素，从而为风险控制提供决策依据。金融机构可以据此改进风险模型，调整风控策略，减少因市场波动带来的潜在损失。研究的部分研究成果还可帮助提升对市场极端事件的应对能力，通过对高频变量的使用和波动率特征的动态变化分析，能够识别市场中的潜在极端风险事件。金融市场参与者可提前采取防护措施，规避由市场异常波动导致的系统性风险。项目成果已在权威期刊发表或立项，具有显著的创新性和应用价值。
2	一等奖	张华	提交的课题《江西省金融风险指数分析》，该课题涵盖了中小金融机构、地方政府融资平台经营性债务、上市公司、房地产、大型企业集团资金链、“7+4”类地方金融组织、非法金融活动等领域的金融风险等风险，通过对金融供给侧、需求侧、政府部门及其他渠道的风险数据信息的研究分析，构建包含8个一级指标和24个二级指标的风险评价体系，结合主观、客观赋权的方法为指标赋权，在此基础上构建了金融风险指标模型。利用构建的金融指标模型计算得出全

			省11个设区市和100个县（区）的金融风险指数，在此基础上融入影响较大的负面清单因素，最终形成综合反映金融风险状况的市县两级风险地图，根据风险程度由高到低按红、橙、黄、蓝、绿五个等级颜色在平台上展示。并根据数据实时调整各个市、县及区的金融风险指数。该成果已在江西省地方金融管理局得到全面展示，并获得省领导重要批示，具有显著的创新性和应用价值。
3	二等奖	喻家驹	提交的论文为《Digital transformation,total factor productivity, and firm innovation investment》。文章基于数字经济快速发展的背景，利用我国2012年至2021年A股上市制造业公司的数据，从全要素生产率视角研究了数字化转型对企业创新投资的影响。主要贡献在于从生产与创新部门间资源竞争的角度开展分析，发现数字化转型在显著提升企业的全要素生产率的同时，也会抑制金融资本和人力资本在创新部门的配置，并降低企业创新投资水平。这一观点挑战了数字化转型始终正面促进创新的传统看法，并为如何在资源有限的情况下优化金融资本在企业生产与创新部门间的配置提供了相应政策建议，具有显著的创新性和应用价值。该成果已被期刊《Journal of Innovation & Knowledge》接受，发表于2024年第2期，该期刊被SSCI收录，为JCR Q1期刊，2023年影响因子为15.6，具有较高的学术影响力。
4	二等奖	盛积良	团队致力于风险测度的理论、方法与应用研究，在多元时间序列的尾部风险及相依关系的度量、文本数据和删失数据情况下的尾部风险建模等方面开展了序列研究，已经在《管理科学学报》《中国管理科学》《Economic Theory》《系统科学与数学》等国内为权威期刊发表和录用论文4篇，并有多篇论文在国内相关会议进行交流。有效的风险测度不仅可以降低资本投资的风险，而且可以提高金融市场风险管理的有效性，有助于监管机构更加有效地监控和防范风险暴发，对于维护金融市场稳定、确保经济稳定发展具有重要的理论意义和现实意义。
5	二等奖	刘庆	刘庆提交的论文《Uncertainty Comparison Between Value-at-Risk and Expected Shortfall》，比较了两种流行的风险度量VaR和ES的非参数推断的不确定性，分别在独立同分布正态分布、独立同分布t分

			布、平稳AR(s)正态分布、平稳AR(1)和t分布四种情形下给出了VaR和ES非参数估计的渐近方差的数学表达式；通过数值计算比较了99%水平的VaR和97.5%水平的ES渐近方差的大小关系，考察了边际分布的重尾性和相依关系对渐近方差的影响。研究发现：重尾情形下99%水平的VaR非参数推断效率优于97.5%水平的ES，基于8种模型的随机模拟和对2个现实保险数据集的分析也验证了这一发现，说明业内普遍认为的“ES更能反映尾部特征从而更适用于重尾情形”这一观点是值得商榷的。论文研究结果适用于金融、保险中重尾风险度量问题，有助于理清两种风险度量的优点和缺点，选取合适的风险度量工具，更精确地量化极值风险，有效防范系统性风险的发生。
6	二等奖	华佳林	提交的课题《面向金融数据的信息抽取技术研究》，该课题围绕金融机构、政府部门、相关企业单位等积累的大量历史及运营数据的信息抽取问题展开研究。金融机构的海量数据具有多源、异构、专业术语多等特征，给数据到信息的转化带来巨大挑战。团队通过大量的语料分析及测试，深入挖掘了金融数据的浅度和深度特征，分析多种类型的信息抽取算法对金融领域数据的抽取效率及可用性。在此基础上设计了强领域特征的信息抽取系列算法并开发出相应软件平台。该成果在实际使用中的性能表现较原有方法具有显著提升。

公示时间从2024年10月30日至11月3日17:00止。如有异议，请在公示期内以口头或书面形式向学院科研与研究生管理办公室反映，反映情况要真实具体，以便调查核实。

学院科研与研究生管理办公室：0791-83951042

江西财经大学统计与数据科学学院
2024年10月30日

