



金融投资研习社——如何通晓卖方 机构量化投资的黑盒

尊敬的 _____ 先生/女士，您好！

金融投资研习社——如何通晓卖方机构量化投资的黑盒将于2017年10月在上海召开。

会议内容

作为宽客或量化投资爱好者，你有机会接触到卖方机构深层的量化思路与模型吗？

答案是

或许

1971年

巴克莱发行了世界上第一只指数基金。拉开量化投资的序幕，量化投资在境外已经有40多年的历史。

2005年

ETF套利的开展，中国步入量化投资领域。

2017年

量化投资在中国已经有10多年的发展史，从2007年仅有2家量化基金，发展到如今的169家。

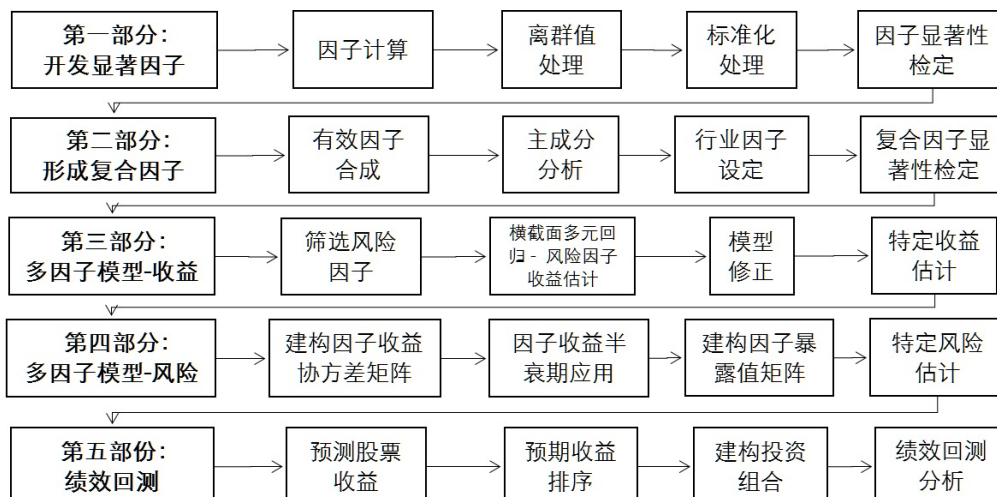
量化投资在国内市场成为券商、公募基金、期货圈以及少部分个人投资者的主流。其中，Alpha策略运用甚为广泛，但2014年及2015年大部分Alpha策略在痛苦中度过，到如今，现在很多的Alpha策略放开行业中性、市值中性的约束，结合CTA策略、结合场外期权产品，同时也在寻找新的数据源，暨全新的Alpha来源，来完善Alpha策略。**在这个鱼龙混杂的年代，你是否能弄清量化与神话的区别？**

当然，量化投资是一个庞大概念，全盘通晓的人不到1%，每个人都有自己擅长的领域，**取长才能补短。**

如果你是宽客，你觉得下面这张图说的对吗？



多因子模型建构流程



如果你是量化投资的爱好者，你是否已经知晓下面问题的答案？

- 1.你知道什么是CTA策略、Alpha策略？常见量化策略有哪些？各种策略的优劣在哪吗？
- 2.你知道公、私募机构量化套利目前存在的问题是什么？有什么解决方案吗？
- 3.你知道如何在实务上或投资时分辨一个量化或套利策略的优势吗？
- 4.你知道通过哪些指标评估与选择值得投资的私募基金？分辨量化私募基金的好坏吗？
- 5.你知道光大机构多因子构建的5大流程与方正金工量化套利策略研究方向吗？

如果以上问题在你脑中沒有答案，《金融投资研习社——卖方机构的量化投资之道》**将解给你想要的答案！**

会议日程

日期/时间	课题	日期/时间	课题
10月21日 9:00-12:00	如何选择私募基金（钟伯君） 1.何为二级市场中的私募基金 2.目前市场上私募基金的种类（交易模式、交易标的、国外情况） 3.私募基金与公募基金的不同之处 4.私募基金的投资思维 5.CTA模式、Alpha策略及与常见量化策略分析 6.如何评估与选择值得投资的私募基金 实践（课件习题与作业）	10月22日 9:00-12:00	如何从财报中挑选优质投资标的（李伟） 1.财务报表分析的意义 2.三大财务报表的分析重点（资产负债表、现金流量表、利润表） 3.重点关注的几个财务指标解析 4.如何识破财务造假 5.从财报看市场风格转换和行业配置 6.从财务报表透析行业和上市公司 7.讨论议题 实践（课件习题与作业）
13:30-17:30	公开市场中的对冲及套利策略（高子剑） 1.我的金融衍生品研究历程 2.国内公开市场中量化及套利的特性与发展情况 3.常见公、私募机构对量化套利的问题与解决方案 4.量化策略在不同市场中如何运用（例如股市的异动复盘，商品期货CTA...） 5.个人能从量化套利交易吗？ 6.如何在实务上或投资时分辨一个量化或套利策略是有优势的？ 实践（课件习题与作业）	13:30-17:30	股票投资策略研习（林百盛） 1.我的股票投资历程 2.基本面还是技术面（数据、指标、筹码） 3.投资趋势还是短线投机 4.国内股市现状及发展趋势（非行情解密） 5.专业交易员如何挑选行业板块及潜力个股 6.风险评估及制定交易策略 7.挑选适合自己的投资方式（基金、ETF、自营操作） 8.后势展望与总结 实践（课件习题与作业）

会议嘉宾

经得起验证师资力量

钟伯君

光大证券上海分公司机构业务部负责人



曾担任摩根士丹利证券台北分公司副总裁及交易部主管；花旗所罗门美邦证券台湾分公司交易部主管；美林证券纽约总部全球外汇私人客户部业务经理。

拥有超过20年的证券期货机构业务开发、证券期货和衍生产品 Alpha 交易策略及量化模型研发与实际交易执行、量化投资业务开发与创新研究经验。

收获：看懂私募产品，避免掉入非法集资陷阱；分清私募产品好坏，选择更具价值的好产品，获得钟老师量化投资建模的5大流程。

高子剑

方正证券金融工程首席分析师，所长助理，执行董事。



多次<新财富>金融工程最佳分析师前三名、卖方分析师水晶球奖、中国证券业金牛分析师奖。

拥有超过20年的全球衍生品交易策略研究，对冲基金操作、股指期货套利、期货价差交易、期货程序交易、期权无风险套利、期权卖方锁利、期权持有波动度等交易经验。

收获：获得公、私募机构对量化套利的问题的解决方案；学会不同市场运用不同量化策略；在实务上或投资时分辨一个量化或套利策略优劣势，获得高老师的卖方分析师的量化投资思路。

李伟

福盈商学院首席研究官



历任多家券商（江海证券、中银国际证券），中国人民银行，私募基金，PE 等机构资深分析师、研究部负责人，基金经理、首席分析师，董事总经理等职务。

从业近 10 年，研究领域涉及海内外宏观经济、政策、市场（A 股及新三板）等。投资领域涵盖 A 股、新三板和金融衍生品市场。

收获：读懂财务报表，看懂重点财务数据，分辨财务造假；通过财报配置行业选择优质上市公司。获得李老师的财报分析数据思路。

林百盛

投顾咨询公司首席分析师



曾任群益证券(台湾)、KGI 凯基证券(台湾)研究和交易团队成员。曾创下 50 倍获利战绩、连续 27 个月营利的惊人战绩！曾在 EPL 和 DMI 担任过私募操盘手及交易主管，团队操作资金达 5 亿美元以上。

近 20 年理论与实战的结合，针对主力操盘手法的分析，创立了一套极具实战价值的交易方法。后经不断完善与实践验证发现，无论牛市还是熊市，该方法均能取得极佳的波段操作利润。

收获：学会以专业交易员的眼光挑选行业与个股；通过每个人的不同点，找出适合自己的交易模式；学会股票的风险风险评估与制定自己的交易策略，获得林老师交易策略。

会议门票

原价16800元，**活动家专享12600元。**

费用包含

- 1.精美茶歇（每日两次）以及自助式午餐（每日一份）。
- 2.价值288元的技术分析教程一本。
- 3.价值2000元的福盈技术分析筛选器一个月帐号一组。
- 4.价值3688的Martin Pring技术分析课程全系列视频。

