



第十二届（2017秋季）中国量化投资国际峰会

尊敬的_____先生/女士，您好！

第十二届（2017秋季）中国量化投资国际峰会将于2017年12月在深圳召开。

会议内容

前言

量化投资在中国金融市场已经风风雨雨走过了12个年头，经过业界人士的不懈努力，量化投资已成为国内投资界不可或缺的重要组成部分。2017年，量化投资开启了新的篇章，行业政策和市场监管制度的破旧立新、国内资本市场不断扩容、投资品种和盈利模式推陈出新，其未来的发展空间不可估量。伴随量化投资领域的扩展和深化，中国量化投资国际峰会也迎来第十二届的辉煌，峰会作为投资精英倾情交流、探讨合作的高端优质互动平台，已成为国内量化投资行业发展风向标和前哨站。

当前，国内金融市场和法律环境逐步成熟与规范，形成了鼓励金融创新的政策环境，聚集了大量海内外优秀的金融人才。不过对量化投资来讲，却并非一帆风顺。在今年上半年，全国金融工作会议召开，第三方交易接口遇到空前危机，豆粕和白糖期权正式上市……金融监管、衍生品品种和量化新策略形成了新的投资环境和机遇。基于大数据、云计算、人工智能、区块链等一系列技术创新的金融科技产业掀起了一股创新创业的热潮。创新为动力，科技为先导，产品和业务的新变化都有利于量化投资技术发挥其作用。在鼓励金融创新的政策环境下，科技手段日新月异，金融业务不断深化，如何利用科技进步优势并结合最新的金融理念，提高量化投资产品和服务的品质；如何开创新新的对冲基金管理模式；新形势下量化投资者该如何应对不断成熟的市场和日趋激烈的竞争；如何发挥人工智能和数据挖掘对量化投资领域的推动作用，这些问题都值得我们深入研究探讨。

基于此，2017年12月15-17日，由中国量化投资研究院、上海交通大学安泰经济与管理学院主办，深圳国泰安数据技术有限公司承办的以“新趋势·新前沿·新机遇——中国特色的量化投资”为主题的“第十二届（2017秋季）中国量化投资国际峰会”在深圳举办。它将推动中国量化投资领域更好更快地向前发展，对促进中国量化投资行业进军全球金融市场前列具有深刻的现实意义和指导作用。

本届峰会将邀请20多位包括优秀对冲基金经理、量化投资领军人物、交易所研究代表在内的投资领域专家，与400多位来自证券、基金、私募、信托、银行、保险界的专业人士，以及信息技术服务商和民间资本代表，共同探讨新政策环境下量化投资在更广阔领域的发展方向，以促进我国量化投资的良性发展，为中国量化投资树立新的风向标。

主办单位：中国量化投资研究院、上海交通大学安泰经济与管理学院

承办单位：深圳国泰安数据技术有限公司

协办单位：中国量化投资学会、深圳市中宽信息科技有限公司

合作媒体：上海证券报、东方财富网、宽客俱乐部、私募排排网、中金在线、操盘天下网、基金买卖网等

会议日程

时间	活动
2017年12月15日（星期五）全天	研修班

08:20-08:50	注册接待
09:00-12:00	量化投资高级研修班
12:00-13:15	交流午餐
14:00-17:00	量化投资高级研修班
18:00-20:30	大咖私房晚宴
2017年12月15日（星期六）全天 研修班	
08:20-08:50	注册接待
09:00-12:00	量化投资高级研修班
12:00-13:15	交流午餐
14:00-17:00	量化投资高级研修班&结业仪式
18:30-20:00	欢迎晚宴（限受邀嘉宾）
2017年12月17日（星期日）上午 开幕式/高层演讲	
08:20-08:50	注册接待
09:00-09:30	开幕式·开幕致辞
09:30-10:15	高层演讲A：国内外量化投资行业的最新技术和发展趋势
10:15-11:00	高层演讲B：全新市场环境下的量化策略综述
11:00-11:45	高层演讲C：人工智能时代下量化投资技术展望
12:00-13:15	交流午餐（限受邀嘉宾）
2017年12月17日（星期日）下午 专题论坛	
13:30-14:45	<p>专题论坛1：大变革：原油期货带给量化投资新机遇</p> <p>2017年6月，上海国际能源交易中心（INE）开始受理客户申请交易编码，标志着原油期货开户正式开始。在此之前，原油期货已成为国内外期货投资者最为关心的交易品种之一，而这将也是我国的首个国际化期货品种，国内外的投资者都可以参与进来，也真正助推着我国期货行业向国际市场大踏步前进。</p> <p>主要议题：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 量化投资如何利用原油期货获取新的投资机会 2. 原油期货与传统期货品种的区别及发展趋势

	3. 在原油期货的投资中如何做到风险规避
14:45-16:00	<p>专题论坛2：期权时代：商品期权为量化投资注入新动力</p> <p>今年上半年，白糖和豆粕期权终于与投资者见面。商品期权作为期货市场的一个重要组成部分，是当前资本市场最具活力的风险管理工具之一，具有独特的经济功能和较高的投资价值。随着半年的发展，期权品种带来的获利机会和衍生出的新策略越发引起了投资者的关注。</p> <p>主要议题：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 商品期权的特点及交易策略 2. 量化投资在期权交易上的应用 3. 如何利用量化投资设计商品期权的套利策略
16:00-17:15	<p>专题论坛3：大势所趋：量化投资在私募基金中的全新布局</p> <p>2017年8月，国务院发布《私募投资基金管理暂行条例（征求意见稿）》，意味着对私募基金的监管即将上升到行政法规层面，我国私募监管法规体系逐步完善。在新的环境下，私募的量化基金的运作就遇到全新的挑战，与此同时，量化投资已然成为私募基金新的风口，未来中国量化型私募基金的前景值得人们进行深入思考。</p> <p>主要议题：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 量化型私募基金的常用策略与方法 2. 量化投资如何在风控等方面为私募基金的主动投资补齐短板 3. 在新的市场监管环境下，量化型私募基金的未来走向

第十二届（2017秋季）中国量化投资国际峰会 量化投资高级研修班	
2017年12月15日 星期五（上午）	
09:00-10:30	<p>第一讲 量化投资策略应用与实践</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 量化投资的理论基础 ● 十大对冲基金策略分析 ● 量化对冲策略阐述 ● 量化交易系统的构成和实操过程
10:45-12:00	<p>第二讲 高频交易和高频交易技术</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 高频交易的历史和现状 ● 高频交易的策略 ● 交易的风险控制和风控技术
2017年12月15日 星期五（下午）	
14:00-15:00	<p>第三讲 对冲基金的相对价值策略实战</p> <ul style="list-style-type: none"> ● 相对价值策略的特点和分类

14:00-15:30	<ul style="list-style-type: none"> ● 相对价值策略的风险 ● 影响相对价值策略的因素 ● 相对价值策略对冲基金案例
15:45-17:00	第四讲 阿尔法套利与统计套利 <ul style="list-style-type: none"> ● 阿尔法套利原理 ● 多因子选股和波动率分析 ● 统计套利原理 ● 股指期货统计套利和波动率统计套利
2017年12月16日 星期六（上午）	
09:00-10:30	第五讲 量化新机遇(一)商品期权 <ul style="list-style-type: none"> ● 中国期权市场结构 ● 商品期权全新机会 ● 期权交易投资策略
10:45-12:00	第六讲 量化新机遇(二)原油期货 <ul style="list-style-type: none"> ● 全球原油期货概况 ● 原油期货的套期保值 ● 量化交易策略在原油期货投资中的机会
2017年12月16日 星期六（下午）	
14:00-15:30	第七讲 量化投资中的风险管理(一) <ul style="list-style-type: none"> ● 风险及资金管理的定义和辩证理解 ● 资金管理的原则和流程 ● 交易头寸计算
15:45-17:00	第八讲 量化投资中的风险管理（二） <ul style="list-style-type: none"> ● 多品种风险管理及头寸配置方案 ● 账户权益曲线管理 ● 热门量化投资风险控制模型解析

注：授课内容可能会根据授课讲师实际情况作适当调整。

【授课讲师】（拟）

陈兴中 AllianceBernstein Invest. 算法交易策略全球研发总监

陈兴中博士现任联博投资公司(AllianceBernstein Invest.)任公司算法交易策略全球研发总管，执掌其全球算法交易策略研究，算法实施及交易系统开发。对高频交易策略模式识别，反博弈及高频阿尔法，风险优化及微观冲击模型有深入研究。对北美、欧洲及亚太地区各主要证券市场金融标的的微观结构、交易模式识别及相应的算法策略有系统研究，并开发出联博全球通用算法交易系统。

丁鹏 上海荣石投资管理有限公司董事长，中国量化投资学会理事长

丁鹏博士是中国量化投资领域研究的先行者，开拓者，2014年计入东航金控任财富管理中心 总经理，从事领航基金系列产品的开发。

2012年进入是方正富邦基金，从事量化对冲产品设计与投资。2008年进入东方证券金融衍生品总部，任投资经理、全球量化策略小组负责人，团队管理资金超过10亿。他同时还是多个基金公司、阳光私募和海外对冲基金的特别顾问，影响资金超过100亿。

他的著作《量化投资》是中国第一本介绍量化投资策略方面的教材，量化投资的奠基之作。全书用60多个案例，详细阐述了选股、择时、对冲、算法交易等核心量化策略，业内人士誉为量化投资的“圣经”。

丁鹏同时还是“CCTV证券资讯频道”“第一财经”等电视媒体的特约嘉宾、《第一财经日报》《经济观察报》等平面媒体的特约撰稿人，具有广泛的媒体影响力。

丁鹏博士2001年毕业于上海交通大学计算机系，获得工学博士学位，并于同年留校任教，是国际知名的人工智能研究员，美国电子电气工程师学会（IEEE）、美国金融学会（AFA）会员，在国际顶级刊物和会议上发表过十余篇学术文章，获得国家发明专利5项。

他已经培训过的机构包括：嘉实基金、华泰证券、山西证券、招商银行、东证期货、永安期货，国际期货等。

李斌 复兴资本公司联合创始人，首席执行官 1984年获中国科技大学理论物理学学士学位，1985年通过李政道项目中美物理联合招生赴美留学。1992年获纽约大学物理博士学位。在著名的客朗数学科学研究院做了一年博士后研究工作后，加入美林证券，并因其在证券研究和交易策略方面的杰出工作很快被提升为副总裁。1997年加入瑞士银行，继而成为瑞士银行在北美的六人执行委员会成员之一。1998年，瑞士银行与瑞士联邦银行合并之后，成为其投资银行分公司Warburg Dillon Read 执行董事及全球数量交易策略部主任。2000年离开瑞银，联合创立了Westport Financial LLC，担任董事会主席兼总裁，在WF旗下创建了股道证券公司、汇通公司、商理基金管理公司和在香港成为第一金融门户网站的阿斯达克财经网(AAStocks.com)。李先生因其在金融投资领域的卓越业绩和传奇经历，与江平、黎彦修被并称为“华尔街三剑客”。

刘宏 摩旗投资管理有限公司董事长

刘宏先生，上海摩旗创始人，董事长，投资决策委员会主席。1990年5月从场外交易开始参与A股市场投资，见证了新中国证券市场诞生和发展的全过程；1994年3月创办深圳新德利公司，在国内首家推出基于数据通讯的证券信息服务平台，开创行业先河，该项服务后来演变成众所周知的内嵌在行情分析软件中的“F10”功能，成为事实上的行业标准；1996年率领团队开发并推出了国内最早的程序化交易系统，在无盘工作站和Dos操作系统框架下实现了模型驱动的程序化交易，引领了国内交易技术的重大创新；从1994年到2003年期间带领自己创办的IT公司专注于为金融领域提供IT解决方案，主要服务对象是券商和基金公司，主要业务是系统集成和金融应用软件开发。

2003年5月刘宏先生创办博弘投资，在国内率先打出了数量化投资的旗号，并在此后10年间的实际投资和研发过程中指导和影响了当前活跃于国内数量化投资领域的一大批后起之秀和业界精英；2009年起至今，刘宏先生在上海交通大学海外教育学院讲授课程《国际对冲基金》。

明可炜 美国骑士资本董事总经理、高频交易总监

明可炜先生于2008年8月至2013年7月于奈特资本集团担任董事总经理（Managing Director）一职，为奈特资本集团建立了模型自动交易部门。领导部门开发交易股票以及期货的高频自营交易策略。在最近五年里，一共盈利8300万美元，总Sharpe比率为4.6。2006年4月至2008年8月于美林证券任总经理（Director），作为高频限价单做市部门总管。领导部门员工设计，开发，并优化基于统计模型的高频自营交易策略。为公司实现总收入超过3000万美元。作为市场微观结构研究部全球主管。明可炜先生主持建立了一个全球的部门，主要任务为优化各种算法交易系统。研发的课题包括：最优化交易时间，日内流动性以及风险预测，对各种交易策略的交易费用评估，顺序化优化，以及电子交易中的最优市场选择，等等。2000年至2006年分别担任过投资科技集团公司副总裁、德意志银行副总裁、“深邃价值”公司创建人等重要职位。

孙东宁 博士（Danny Sun, Ph.D.）德意志银行量化服务组(执行)总监

2004年，进入金融领域，先后供职于Swiss Re (瑞士再保险金融交易部), Citigroup (花旗集团投资银行), UBS (瑞士银行投资银行)和Deutsche Bank (德意志银行投资银行),从事量化模型和交易策略的研究，开发和交易支持。主要方向：固定收益产品(尤其是利率产品和信贷产品)的定价，风险控制与对冲，和新产品开发。现担任德意志银行量化服务组(执行)总监，为多种利率交易(Callable Agency Desk; Municipal Cash & Derivative Desks; etc)的定价及风险提供解决方案和技术支持。

杨兆吉博士：美国灵活计划投资公司投资研究总监、投资副总裁

杨兆吉博士在过去五年中任美国灵活计划投资公司的投资研究总监和投资副总裁。这家在美国证监会注册的投资管理公司现管资产十五亿美元。杨博士在此职位上指导公司的量化投资策略的研发和运行，并兼任该公司代管共同基

金的基金经理。

杨博士获得的专业认证有专业金融分析师(CFA)，金融风险经理(FRM)，和认证投资代权师(AIF)。他的研究专文在2010年和2012年分获美国全国动式投资经理协会威格纳研究竞赛第二名和第三名。他曾获得美国康奈尔大学工程博士学位，密执根大学工商管理硕士学位，和中国科技大学理学学士学位。杨博士曾在密执根大学客座讲授金融工程另类投资课程。他的有关动态资产配置暨风险控制的学术论文2013年拟在中国金融评论（国际版）发表。

郑坂 法国领先资产管理公司量化研究员

郑坂先生获巴黎综合理工大学工程师学位和法国国立统计与经济管理学院(ENSAE Paris Tech)工程师学位，法国国立高等电信学院(Télécom Paris Tech)应用数学专业博士学位。曾在法国外贸银行(NATIXIS)从事统计套利的策略研究，现就职于法国兴业银行领先资产管理公司担任研发部研究员，从事资产管理领域的研究工作，专注于金融大数据的处理，对冲基金的投资策略，指数跟踪产品的研究以及量化管理基金的策略开发。现兼任同济大学法国校友会会长及法国博效基金会秘书长。

会议门票

峰会参会：1280元

量化投资高级研修班（12月15-16日）：6800元

