**关于召开2017年第二届中国金融程序化交易教学**

**高级研讨会的邀请函**

老师：

在计算机、互联网、大数据和人工智能技术迅速发展的今天，量化交易、算法交易、程序化交易、智能化交易正在快速发展，并将在不久的将来逐步取代大部分的人工交易。我国金融市场的程序化交易虽然起步较晚，但近几年发展迅速，市场对程序化交易高级人才的需求巨大。今年6月在上海召开首届高校中国金融程序化交易教学高级研讨会后，许多高校纷纷开设或积极准备开始程序化交易课程。为进一步推进中国程序化交易专业人才培养和技术发展，复旦大学金融研究院、四川大学经济学院将联合举办第二届中国金融程序化交易教学高级研讨会，同时邀请国信证券有限公司程序化交易服务团队业界具有丰富程序化交易实战经验的专家做专题报告。会议将围绕怎样利用面向对象编程语言，在程序化交易平台实现多资产组合交易策略问题展开研讨。会议将赠送陈学彬教授主编，复旦大学出版社最新出版的介绍这些方法、策略和程序的《程序化交易中级教程(国信TradeStation量化平台)》，国信证券将为参会院校师生提供国信TradeStation量化平台使用的技术支持。研讨会定于2017年12月1-3日在成都召开，诚挚邀请您参加。现将有关事项通知如下：

一、组织单位

主办单位：复旦大学金融研究院、四川大学经济学院

承办单位：四川大学经济学院

协办单位：国信证券公司、高等教育出版社、复旦大学出版社

1. 会议内容

首届全国高校程序化交易教学高级研讨会主要讨论程序化交易的基本原理、策略开发的基本框架和步骤、基本的程序化交易策略等。第二届会议将在首届会议的基础上，进一步拓展深化程序化交易策略的开发和应用，重点围绕怎样利用面向对象编程语言，突破传统程序化交易平台无法进行多资产组合交易的局限，扩展程序化交易功能，在程序化交易平台上实现多资产组合交易，如选股、择时、对冲、套利、资金管理和风险控制等策略问题展开深入研讨，并邀请具有丰富交易实战经验的业内专家介绍利用多资产组合交易方法进行对冲、套利的经验。主要包括以下内容：

**报告一、量化交易的发展趋势**

介绍量化交易发展的基本趋势、量化交易平台、量化交易编程语言的发展趋势。

主讲人：**吴良**，现任四川大学经济学院特聘副研究员，实验室主任。毕业于布朗大学，获应用数学硕士和理论物理博士学位，曾在芝加哥komico llc，icy capital等对冲基金公司从事期货市场期权等衍生品的量化交易工作5年。

**报告二、非传统理性投资者的风险偏好与投资行为分析**

主讲人：**张金清，**复旦大学教授，博士生导师，金融研究院常务副院长、经济学院副院长、应用经济学博士后流动站站长，兼任上海金融工程学会副会长、上海金融学会副会长、全国金融专硕教学指导委员会委员，主要研究领域：金融风险管理、金融工程。

**报告三、程序化交易的系统应用**

重点讨论程序化交易所需的数据基础、应用平台、委托报送，以及国信证券围绕程序化交易提供的数据、平台等交易服务。

主讲人：**陈俊杰**，新加坡管理大学应用金融硕士，现任国信证券总部交易服务团队产品经理，负责产品培训工作，在线上与线下主持过上百场的培训课程，参与人数逾上万人次。第七届私募金牛奖金牛投资分享会演讲嘉宾，对国内证券量化交易解决方案有丰富的经验。

**报告四、面向对象编程语言及在国信TradeStation交易平台的应用**

重点介绍面向对象编程语言基本规则及其在国信TradeStation程序化交易平台的应用

主讲人：**高文雪**，国信证券上海分公司产品经理，主要负责量化交易服务，为念空科技、呈瑞投资管理等知名私募机构提供策略咨询、量化系统部署方案，具有丰富的系统部署、研发经验。

**报告五、股票程序化交易策略**

重点讨论程序化选股策略、股票组合交易策略、分析图股票组合交易策略、雷达屏股票组合交易策略、股票套期保值（股票对冲交易）策略在国信TradeStation量化交易平台的应用

主讲人：**吴文娟**，国信证券总部交易服务团队产品经理，负责策略及交易应用研发工作；有丰富的对冲、短线策略研究经验，擅长基于技术形态分析做股票或期货的择时交易。

**报告六、期货套利和套保交易策略**

重点讨论程序化期现套利交易策略、股指期货跨期套利策略、ETF协整套利策略在国信TradeStation量化交易平台的应用

主讲人：**陈学彬教授**，复旦大学教授，博士生导师，曾任复旦大学金融研究院常务副院长、中国金融学会、中国国际金融学会常务理事和学术委员、上海金融学会副会长、国家自然科学基金管理学科评审组专家、全国金融专硕教学指导委员会委员。主编出版了《程序化交易初级教程》、《程序化交易中级教程》、《程序化交易》、《期权策略程序化交易》。

**报告七、期权套利和套保交易策略**

重点讨论期权平价套利策略、期权垂直套利策略、期权箱型套利策略、行权价差组合策略、期限价差组合策略、对角价差组合策略在国信TradeStation量化交易平台的应用

主讲人：陈学彬教授

**报告八、算法交易策略**

时间加权平均价格算法TWAP交易策略、交易量加权平均价格算法VWAP交易策略在国信TradeStation量化交易平台的应用

主讲人：陈俊杰

**报告九、动态资金管理和资产配置策略**

重点讨论动态资金管理和资产配置原理和策略类型、等价鞅与反等价鞅动态资金管理策略、动态资产配置的分析图交易、动态资产配置的雷达屏交易在国信TradeStation量化交易平台的应用

主讲人：吴文娟

**报告十、策略交易实战经验分享（一）：超越板块的量化策略**

主讲人：**卢晨曦**，涵基投资创始人，上海交通大学流体力学博士，于1989年涉足证券市场，2000年涉足IT业，2002年涉足金融IT业，拥有多年的股票投资和IT行业经验，精于数理建模。2004年开始研究量化对冲投资，并自主研发了ETFgo全自动量化对冲交易平台，在2010年期指推出当日即带领团队成功实现全自动精准对冲交易。拥有二十余年证券市场经验、十余年成熟的软件编程技术、丰富的量化投资实战经验，是国内量化对冲投资先行者。

**报告十一、策略交易实战经验分享（二）：复合策略投资**

**主讲人：**韩俊杰，鼎一基金创始人，毕业于中国科学技术大学统计系，2009年至2011年在澳大利亚昆士兰大学攻读金融工程，回国后先后就职于深圳某百强集团企业旗下私募基金和国信证券总部，具有5年以上量化和投资经验。

三、参会办法

时 间：2017年12月1日-12月3日，12月1日（周五）全天报到。

地 点：成都新良大酒店（成都市锦江区东大街上东大街段246号（西南书城旁），电话：028-86739999）

联系人：杨莎莎（电话：13982086903；微信号：13982086903；邮箱：2850676195@qq.com；QQ：2850676195）

费 用：本次会议不收取会务费，会议期间的交通、食宿费自理。

成都新良大酒店住宿费：商务标间（双床）360元/间，商务单间（大床）360元/间（均含早）；住宿费由住宿酒店开具发票。

复旦大学金融研究院

四川大学经济学院

2017年10月26日

**2017年第二届中国金融程序化交易教学高级研讨会**

**邀请函回执**

1. 为方便接待工作，请务必在2017年11月24日（周五）前将回执通过电子邮件或短信、电话、微信发给大会的联系人杨莎莎（电话：13982086903；微信号：13982086903；邮箱：2850676195@qq.com；QQ：2850676195）。

2.本次会议日程安排如下：12月1日（周五），报到；12月2日（周六）白天，会议主题报告；12月2日（周六）晚上，探讨与交流；12月3日（周日）上午，会议主题报告；12月3日（周日）下午，国信证券组织拓展活动。

**邀请函回执表**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 学校名称 |  | | | | | |
| 姓名 | 性别 | 职务、职称 | 手机 | 电子邮箱 | 住宿标准 | QQ号 |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
| 注：  住宿标准有：**标间单住、标间合住、单间、自行安排**，可根据需要进行选择。自行预订酒店的请在住宿标准里注明：**自行安排**。 | | | | | | |

酒店周边交通示意图

* 成都双流国际机场（二号航站楼）：19.54 公里 乘坐地铁10号线（太平园方向），途径5站到达太平园换乘地铁三号线（军区总医院方向），途径7站到达春熙路站，步行842米到酒店。打车费用约50元。
* 成都双流国际机场（一号航站楼）：18.57 公里 乘坐地铁10号线（太平园方向），途径5站到达太平园换乘地铁三号线（军区总医院方向），途径7站到达春熙路站，步行842米到酒店。打车费用约50元。
* 成都火车南站： 6.9 公里 乘坐地铁1号线（升仙湖方向），途径5站到达锦江宾馆站，乘坐8路公交车（十里店公交站方向）途径1站到达大业路，步行739米到酒店。打车费用约20元。
* 成都火车东站： 8.12 公里 乘坐地铁2号线（犀浦方向），途径6站到达春熙路站，步行806米到酒店。打车费用约24元
* 成都站： 6 公里 乘坐地铁1号线（广都方向），途径4站到达天府广场站，乘坐43路公交车（蓝谷地方向）途径2站到达春熙路南口，步行170米到酒店。打车费用约15元

