

# 第四届期货机构投资者年会

## 衍生品市场的财富管理

中国期货市场近几年得到了快速的发展，无论是服务实体经济，还是管理资本市场风险，期货市场功能正得到有效的发挥，客户主体结构得到优化，机构投资者将成为期货市场发展的重要方向。为此，上海市期货同业公会、上海市银行同业公会、上海市证券同业公会、上海市保险同业公会、上海市基金同业公会、上海上市公司协会六家上海金融公会定于2013年11月20日在上海国际会议中心联合举办“第四届期货机构投资者年会”。以“衍生品市场的财富管理”为主题，邀请领导以及国内外著名经济学家、行业专家，交流专业知识，解读世界与中国经济的发展趋势，探讨中国期货市场财富管理前沿理念，共享金融资源。

2013年11月20日 上海国际会议中心（滨江大道2727号）

<b>主办单位</b>	上海市期货同业公会 上海市证券同业公会 上海市基金同业公会	上海市银行同业公会 上海市保险同业公会 上海上市公司协会
<b>协办单位</b>	北京大学汇丰商学院 EDP 同学会投资基金专业委员会 上海期货交易所 中国金融期货交易所	
<b>支持单位</b>	中国证监会上海监管局 中国期货业协会 上海金融业联合会	
<b>赞助单位</b>	新湖期货 海通期货 国泰君安期货 上海金源期货 上海大陆期货 申银万国期货 上海东证期货 国投中谷期货 光大期货 上海中期期货 永安期货 东吴期货 东航期货 华鑫期货 中融汇信期货 大地期货	
<b>海外学术支持单位</b>	FOW 期货期权世界 INTL FCStone 寰宇·福四通公司 RTS Realtime Systems 爱特思即时系统信息公司	
<b>学术支持单位</b>	上海交通大学上海高级金融学院 同济大学上海期货研究院 上海陆家嘴期货进修学院	
<b>战略合作媒体</b>	期货日报 上海证券报 中国证券报 证券时报 第一财经 和讯网 东方财经频道 东方财富网 看看新闻网	

## 议程草案

上午第一节 开幕式 一楼华夏厅		
领导致辞		
主持人:		
09:00	中国证监会上海证监局 局长	张思宁
	中国期货业协会 会长	刘志超
	上海期货交易所 理事长	杨迈军
	中国金融期货交易所 董事长	张慎峰
上午第二节 衍生品市场的财富管理		
地点：一楼华夏厅		
主持人：		
09:40	<b>主题演讲：全球及中国经济展望</b>	
—	演讲人：瑞士信贷公司董事总经理	陶冬
10:30	<b>主题演讲：银行参与衍生品市场的思考</b>	
—	演讲人：上海浦东发展银行行长	朱玉辰
11:00	<b>主题演讲：基金运作衍生品产品的经验</b>	
—	演讲人：汇添富基金管理公司	林利军
11:30	<b>主题演讲：衍生品市场在国内外资本市场的作用</b>	
—	演讲人：海通证券股份有限公司副总经理	李迅雷
12:00	<b>主题演讲：全球衍生品市场的借鉴与应用</b>	
—	演讲人：美国芝加哥期权交易所 CBOE 董事总经理	郑学勤
12:20		

分论坛 A：海外对冲基金与财富管理		
地点：一楼华夏厅		
主持人：		
13:00	致欢迎辞:	FOW 期货期权世界 出版总监 Stewart Brown 斯图尔特·布朗
—		
13:10		
13:10	<b>圆桌论坛主题：</b>	<b>主持人：</b> 君合律师事务所合伙人 谢青
—	国际资管业务的发展以及	<b>圆桌嘉宾：</b>
—	与	- 巨石阵资产管理公司和东西方顾问公司创始人
13:10	中国市场的潜在合作机会	Steven Michael 史蒂文·迈克尔
—		- Icarus 交易公司总裁和 Ironball 交易公司首席执行官
14:10		Tim Jacob 蒂姆·雅各布
		- PLOT 管理期货公司总裁和 O&L 全球财富管理
		公司董事总经理 Bob Olivar 敖立宝
		- Crabel 资本管理公司投资组合经理和执行委员会成员
		Paul Buethe
		- 华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问
		Alexandre Werno 韦历山
14:10	<b>主题演讲:</b>	<b>风险管理和国际对冲机遇</b>
—		
14:40		<b>演讲嘉宾：</b> 纽约金融学院讲师, CTA, 徐燕

14 : 40 — 15 : 30	<b>圆桌论坛主题：</b> 海外对冲基金的风险管理 - 对中国财富管理的启示 与借鉴	<b>主持人：</b> 纽约金融学院讲师 ,CTA, 徐燕 <b>圆桌嘉宾：</b> - 巨石阵资产管理公司和东西方顾问公司创始人 Steven Michael 史蒂文·迈克尔 - ADL 资本公司创始合伙人 Bernard Lock 骆嘉辉 - 新加坡辉立期货策略师 王子龙 - 华安证券股份有限公司策略投资总监，CFA 章建宏
15 : 30 — 16 : 00	<b>主题演讲：经济与大宗商品展望</b> 演讲嘉宾： INTL FCStone 寰宇·福四通公司独立商品研究顾问 Edward Meir 爱德华·梅厄	
16 : 00 — 16 : 30	<b>主题演讲：中国对冲基金的发展之路</b> 演讲嘉宾： 同安投资管理有限公司总经理陈东升	
16:30 — 17:30	<b>圆桌论坛主题：</b> 中国资产管理的全球机 遇	<b>主持人：</b> 信诚基金管理有限公司数量投资总监和资深基金经理 吴雅楠 <b>圆桌嘉宾：</b> - 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司副总经理 沈良 - INTL FCStone 寰宇·福四通公司执行副总裁, 全球金属 和机构期货总监 Frederick R. Demler 弗雷德·丹姆勒 - FIA 亚洲执行董事 Bill Herder - 光大证券资产管理有限公司量化投资部总经理 李升东

<b>分论坛 B：期货资产管理与私募阳光化</b>	
<b>地 点： 三楼黄河厅</b>	
<b>主持人：</b>	
13 : 00 — 13 : 40	<b>演讲主题：境外期货资产管理运作与风险管理</b> 演讲嘉宾： Millburn 公司 执行副总裁 Barry A. Goodman 贝瑞·古德曼
13 : 40 — 14 : 20	<b>演讲主题：资产管理业务的演变、创新与挑战</b> 演讲嘉宾：海通证券资产管理有限公司副总经理 王晓东
14 : 20 — 15 : 20	<b>圆桌论坛主题</b> 1、期货资管业务的运营概况 2、期货资管业务的现实机遇和挑战 3、期货资管时代的竞争与合作 <b>圆桌嘉宾：</b> Millburn 执行副总裁 贝瑞·古德曼 海通证券资产管理有限公司副总经理 王晓东 海通期货资产管理部总经理 王克强 新湖期货资产管理部投资总监 朱浪强 申银万国期货资产管理部负责人 陈青瑶
15 : 20 — 16 : 00	<b>演讲主题：私募阳光化的雄关漫道</b> 演讲嘉宾：上海理成资产管理公司 总经理 程义全

16:00 — 16:40	<b>演讲主题：期货私募阳光化机遇和路径</b>	
	演讲嘉宾：华宝信托有限责任公司副总经理兼投资总监 王波	
16:40 — 17:40	<b>圆桌论坛主题</b>	<b>圆桌嘉宾：</b>
	1、期货私募的阳光化路径选择	上海理成资产管理公司 程义全
	2、期货私募孵化体系的建设	宝信托有限责任公司副总经理兼投资总监 王波
	3、财富管理时代的期货私募机遇	中国期货投资家俱乐部副理事长 郑加华

<b>分论坛 C： IT 技术创新与资产管理</b>		
<b>地 点： 一楼世纪厅</b>		
<b>主持人：</b>		
13:00 — 13:30	<b>主题演讲：</b> IT 技术创新与管理 演讲人： 新际集团 Newedge Group (Hong Kong Branch) Head of eSolutions, Asia-Pacific Ivan Marinkovic	
13:30 — 14:30	<b>圆桌主题：</b> 技术创新助推期货创 新品种与创新业务	<b>交流嘉宾：</b> 1、上海期货信息技术有限公司 总经理 肖军伟 2、中国金融期货交易所技术公司 总经理 史光伟 3、大连飞创信息技术有限公司 总经理 刘军 4、郑州易盛信息技术有限公司 总经理 邢向飞
14:30 — 15:30	<b>圆桌主题：</b> 技术创新与财富管理的 互动与融合	<b>交流嘉宾：</b> 1、Efficient Capital Co.,Ltd CEO Ernest L. Jaffarian 2、申万菱信基金管理有限公司 监察长 来肖贤 3、兴业国际信托有限公司 证券信托总部总经理 云志杰 4、华安基金管理有限公司 资深专家 杨 晔
15:30 — 16:30	<b>圆桌主题：</b> 新技术在量化交易与 算法交易中的运用	<b>交流嘉宾：</b> 1、Vincorex AG CEO Dr. Andreas Meyer de Voltaire 2、CEP 平台 姚 嵩 3、UBS(算法交易) 中国区负责人 曲宏杰 4、上海申银万国证券研究所有限公司 金融工程部 杨国平
16:30 — 17:30	<b>圆桌主题：</b> 技术软件供应商的重 要参与	<b>交流嘉宾：</b> 1、金仕达(中国)有限公司 机构交易产品总监 匡志明 2、北京睿智融科控股有限公司(讯投) 技术总监 张学成 3、恒生电子股份有限公司 产品规划部总经理 沈昕嘉 4、上海秦晖信息科技有限公司 总经理 徐 晖

<b>分论坛 D： 场外交易市场与量化投资</b>		
<b>地 点： 五楼长江厅</b>		
<b>主持人：</b>		
13:00 — 13:30	<b>主题演讲：</b> 国外 OTC 市场发展现状及借鉴 演讲人： 花旗银行场外市场 regional head of client solutions Nirav Parikh	
13:30 — 14:00	<b>主题演讲：</b> 国内场外交易市场发展趋势 演讲人： 上海股权托管交易中心 党委书记、副董事长总经理 张云峰	
14:00 — 15:00	<b>圆桌主题：</b> 国内外场外交易 市场的建设及创 新	<b>交流嘉宾：</b> 1、花旗银行场外市场 regional head of client solutions Nirav Parikh 2、上海股权托管交易中心 党委书记、副董事长总经理 张云峰 3、嘉实资本管理公司 副总经理 陶荣辉 4、东方证券股份有限公司衍生品部 副总经理 凌学真
15:10 — 15:40	<b>主题演讲：</b> 程序化交易在国内期货市场的应用及效果 演讲人： 淘利资产管理公司 董事长 肖 辉	

15 : 40 — 16 : 10	<b>主题演讲:</b> 交易算法策略和量化分析		
	演讲人: 荷兰奥帝华公司	资深专家	吕常恺
16 : 10 — 17 : 10	<b>圆桌主题:</b> 程序化交易的创新及发展难题	<b>交流嘉宾:</b> 1、荷兰奥帝华公司资深专家 2、淘利资产管理公司 董事长 3、MagicQuant 公司特聘高级顾问 4、上海东证期货有限公司技术总监	吕常恺 肖 辉 梁 涛 高 超

报名回执:

公司名称		公司地址		邮编
姓名	职务	电话	手机	

请填写好客户回执, 发送至邮箱: 634213066@qq.com, 联系人: 王晓琴, 电话: 13453429087。