附件1

指数和量化投资发展趋势研讨及投资实践

专题培训

**时间：9月19日（周四）9:00-17:00**

**地点：上海**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 时间 | 授课主题 | 授课嘉宾 | |
| **上午** | | | |
| 9:00-9:10 | 领导致辞 | | 协会领导 |
| 9:10-9:40 | 当前国内指数产品投资、交易情况及发展趋势 | | 上海证券交易所产品创新中心副总经理陈代云博士 |
| 9:40-10:30 | 中国指数投资发展历史及现状（指数发展新生态、指数构建及保险指数投资需求） | | 上海华证指数信息服务有限公司总经理刘忠 |
| 10:30-11:20 | 指数、ETF在大类资产配置策略中的应用 | | 华安基金管理有限公司总经理助理许之彦博士 |
| 11:20-12:10 | 保险资金利用指数基金构建FOF产品的尝试 | | 太平洋资产管理有限责任公司量化投资部副总裁徐立群 |
| **12:10-13:30 午餐休息** | | | |
| **下午** | | | |
| 13:30-14:20 | 中国量化投资的发展历程，未来趋势及挑战 | 喜岳投资CEO周欣 | |
| 14:20-15:10 | 保险资金量化投资解析及配置策略 | 太平资产量化及策略投资部门负责人王振洲 | |
| **15:10-15:20 茶歇** | | | |
| 15:20-16:10 | 量化投资模型设计及风险控制实务 | 泰康资产管理有限责任公司金融工程部负责人（董事总经理）任建畅 | |
| 16:10-17:00 | 境外量化投资的风险控制逻辑（市场分散、多元化产品类别及流动性） | 领航投资香港有限公司投资产品总监张子铭 | |