

浙江省国际对冲基金人才协会办公室文件

{2018} 2 号

浙江省国际对冲基金人才协会 2017 年度报告

目录

一、 服务金融，共同发展.....	3
二、 加强行业自律，整合行业资源.....	3
(一) 协会带领浙江证券私募代表团拜访中国基金业协会.....	3
(二) 联合浙江省股权投资行业协会向省金融办提出建立浙江省私募风险监测及服务平台的建议书.....	5
三、 努力发挥桥梁和纽带作用.....	6
(一) 2017 西湖峰会,协会邀请格林威治代表团以及海外嘉宾,上演中美基金小镇“双城论坛”.....	6
(二) 浙江省国际对冲基金人才协会协助格林威治与上城区政府签订友好合作城市协议.....	7
四、 助推行业发展，人才战略发展.....	8
(一) 浙江省国际对冲基金人才协会协助浙江工业大学开办国内首个量化金融系,同时钱塘江金融港湾量化金融报告会圆满召开.....	8
(二) 协会推动 CFA 考场落地杭州.....	10
五、 履行宗旨，服务企业，日常机构办实事.....	11
(一) “小镇财富讲堂”第十四期：2017 年股票与债券市场展望与投资机会.....	12
(二) “小镇财富讲堂”第十五期：期权专场.....	13
(三) “小镇财富讲堂”第十六期：走进高校.....	13
(四) “小镇财富讲堂”第十七期：量化技术在股市上的应用.....	14
(五) “小镇财富讲堂”第十八期：“机器学习在股票市场中的应用”和“期权等衍生品与财富管理”.....	15
(六) “小镇财富讲堂”第十九期：通货膨胀下的外汇商品股指投资机会策略.....	16
(七) “小镇财富讲堂”第二十期：“趋势跟踪 CTA 的发展及其优势”和“力量投资美学——事件驱动”.....	17
(八) “小镇财富讲堂”第二十一期：走进高校（二）.....	17
(九) “小镇财富讲堂”第二十二期：FOF 产品设计及大类资产配置论坛.....	18
(十) “小镇财富讲堂”第二十四期：多元资产配置下的新量化对冲.....	19
(十一) “小镇财富讲堂”第二十五期：纺织品期货论坛.....	19
(十二) “小镇财富讲堂”第二十六期：会员专场.....	20
(十三) “小镇财富讲堂”第二十七期：量化机构“交想汇”.....	21

(十四) “小镇财富讲堂”第二十八期：第十二届金博会“智慧与风控”公益讲堂	22
六、2018年工作计划	23
(一) 继续发挥好协会的桥梁和纽带作用	23
(二) 坚持不懈，服务会员	23
(三) 发挥好协会的监管与督促职能	24
(四) 加强协会建设，提升协会形象	24
(五) 2018年协会计划开展的人才建设项目	24
1. 建立量化金融实验室	24
2. 打造金融人才培养的杭州标准	25
3. 举办千人级别的港湾人才峰会	26
4. 拟在浙江引进落地“工信部金融信息领域急需紧缺人才培养工程”	27

一、服务金融，共同发展

2016年，各理事会、会员单位一起召开了协会筹备会议，同时协会意向会员召开了会员大会，共同制定了成立协会的目标和愿景，于2017年3月正式成立浙江省国际对冲基金人才协会。

最终确定了协会工作的工作方向定位：

协会是国内首个面向全国和海外对冲基金高级管理人才的专业类协会，总部设在杭州。协会的成立是为了贯彻落实钱塘江金融港湾人才战略，配合浙江省委省政府打造“民间财富管理中心”，搭建资产管理行业交流平台，吸引和培养优秀的基金管理人才在浙江工作和创业。协会通过建立金融与实业的交流平台，促进金融服务实业。

二、加强行业自律，整合行业资源

（一）协会带领浙江证券私募代表团拜访中国基金业协会

为了进一步落实浙江省委省政府关于打造浙江省本地基金行业交流平台和人才高地，发挥浙江省国际对冲基金人才协会（省基金人才协会）的桥梁作用，增强浙江省在全国私募行业的影响力，参与行业标准制定和推广本地优秀私募基金品牌。浙江省国际对冲基金人才协会于2017年4月26日带领浙江省证券私募代表团一行20余人到中国基金业协会进行拜访，中国基金业协会多位机构负责人热情接待浙江省证券私募代表团。同时中国证券基金业协会（简称中基协）高度评价浙江省代表团的来访，称此次来访也是有史以来拜访中基协的最大的省级代表团。在与中国基金业协会的交流中，双方就浙江省私

募证券发展与规范制度进行了探讨，中基协希望通过与地方协会建立更紧密的合作关系来更好得服务地方私募基金，同时检查并防范金融风险。相关负责人建议我协会可在浙江省金融办指导下，由中基协授权建立一个省级证券私募基金的“私募备案信息咨询中心”，由省基金人才协会派专员到中基协轮岗6个月以上，熟悉备案流程和监管法规，为省内新设立的私募基金提供咨询和协助处理备案事宜；为切实做好省内私募基金的服务工作，中基协对“私募备案信息咨询中心”提供支持，该中心负责联系省内的基金小镇和产业园区，建立服务点；为进一步推动行业自治，自理和自律，中基协经证监会批准新建立地方监察部并批准单独预算与地方协会合作开展地方私募基金背景审核工作。

会上浙江省国际对冲基金人才协会向中基协汇报了“西湖指数”的相关工作开展进度，中基协对“西湖指数”也是持大力支持态度，表示欢迎省基金人才协会会员机构参与到以母基金发展为主的机构投资者联席会议中来，同时对浙江省本地金融机构建立母基金和规范行业发展给予了高度评价。

在与中基协的交流中，除了向协会提到了多方位合作，中基协也欢迎浙江省国际对冲基金人才协会加入中基协作为特别会员，并加入中基协地方协会联席会议。

在拜访中国基金业协会的过程中，浙江省证券私募代表团的收获非常大，我协会也会将上述合作以及意见逐一落到实处，为浙江省私募证券行业发展做出努力，做好为浙江省证券私募机构提供服务和交

流平台工作。

（二）联合浙江省股权投资行业协会向省金融办提出建立浙江省私募风险监测及服务平台的建议书

金融强省建设离不开金融风险防范，金融强省建设必须同时做好“保障、创新、防范”这“三篇文章”。既要保障金融增长，不断创新金融产品和服务，又要切实加强金融风险防范，把浙江建设成金融运行的安全区。实际上，越是发达的地区，越是金融创新活跃的地区，金融活动所内涵的风险从周期性角度来看，当经就越多，金融风险所引发的问题或危害就越大。经济过热而宏观经济金融政策从紧时期，就会将之前经济高速发展中所积累起来的风险进行释放，极易产生区域性甚至是全国性的重大金融风险。因此，在金融强省建设战略和当前的宏观经济形势下，十分有必要来研究建立金融风险防范的有效机制，通过机制建设，实现对金融风险的有效监控，实现金融风险防范的经常化、制度化和有序化。有利于充分发挥部门的职能优势，有效打击区域性股市场违法违规行，切实防范区域性金融风险，也有利于发挥区域性股权市场的金融服务功能，促进地方经济发展。

浙江省国际对冲基金人才协会、浙江省股权投资行业协会作为省金融办主管下的自律性组织，在联合探讨建设关于建立浙江省私募风险监测机制、意义以及征询协会会员意见后，向省金融办提出了建立浙江省私募风险监测及服务平台的建议书。

三、努力发挥桥梁和纽带作用

(一) 2017 西湖峰会, 协会邀请格林威治代表团以及海外嘉宾, 上演中美基金小镇“双城论坛”

第三届(2017)全球私募基金西湖峰会由浙江省人民政府指导, 杭州市人民政府、中国证券投资基金业协会主办, 浙江省金融业发展促进会、杭州市人民政府金融工作办公室、杭州市上城区人民政府、美国格林威治市政府、中国证券投资基金业协会私募证券专业委员会联合主办。

在此次全球私募基金西湖峰会上, 浙江省国际对冲基金人才协会独立组织由杭州市上城区政府和美国格林威治市政府共同举办的中美基金小镇“双城论坛”。并邀请了来自杭州玉皇山南基金小镇和美国格林威治基金小镇的对冲基金行业精英, 共同探讨中美对冲基金行业的发展、机遇和挑战, 面向未来提出了国际性的分析展望和投资策略。

对于本次活动, 中国证券投资基金业协会会长洪磊给予了极高的赞赏, 并表示玉皇山南基金小镇是目前中国最领先的基金小镇, 同时美国格林威治基金小镇对冲基金发展历史悠久, 资产管理规模位列全球第三, 是名副其实的对冲基金之都。

杭州市上城区常务副区长富永伟也对协会的工作表示认可, 并表示早在玉皇山南基金小镇规划阶段, 该区就对标格林威治基金小镇, 中美基金小镇的“师生情缘”也在协会的和和其他各界人士的努力下由此显现并延续至今。

（二）浙江省国际对冲基金人才协会协助格林威治与上城区政府 签订友好合作城市协议

2017年5月，经过浙江省国际对冲基金人协会的不懈工作和努力下，杭州市上城区区委副书记、区长金承涛率团前往美国，与格林威治市签订友好合作备忘录，双方计划在信息互通、机构合作、人才交流等方面展开深度合作。

到场人员对签署的姐妹城市协议表示赞赏，格林威治市市长 Tesei 表示希望扩大和加强与亚洲，特别是杭州的关系，签署姐妹城市是一个令人兴奋的时刻，也是双方共同一直在努力。并对浙江省国际对冲基金人才协会秘书长郭涛带来的十一位特别嘉宾进行了亲切会务，他表示“姐妹城市”的签订是格林威治和杭州将促进社会，文化和商业关系，以扩大和加强联系，通过举措和项目开展合作，提高两个城市是全球金融中心的认识的重要举措。

会后多家海外媒体对本次签署协议事件做了新闻报道，同时协会也将新闻报道摘选并翻译汇报给基金小镇管委会。

这一举措不仅带动了杭州金融业态发展的市场化、专业化、国际化水平持续提升。同时预示着协会作为行业平台整合对冲基金行业资源，为对冲基金界提供高端人才交流平台一级助力在杭州打造对冲基金产业链和建立财富管理中心的作用。通过这一友好合作协议的签署也展示了协会引进海内外高级基金管理人才和优秀对冲基金在对冲基金园区落户，帮助中国对冲基金走向国际化的巨大作用。

四、助推行业发展，人才战略发展

（一）浙江省国际对冲基金人才协会协助浙江工业大学开办国内首个量化金融系，同时钱塘江金融港湾量化金融报告会圆满召开

浙江工业大学与浙江省国际对冲基金人才协会（Zhejiang International Hedge fund Talents Association, HTA）合作，设立金融学（量化金融）专业，教授金融工程、人工智能、大数据、机器学习和神经网络等前沿科技，成为了国内首个以金融科技在资产管理领域应用为主要方向的学科。

浙江工业大学校长蔡元强结合学校办学特色和量化金融的应用前景指出，在投资管理中用专业的量化分析方法是金融业未来的发展方向之一，因此创新设置量化金融系十分必要，既能够实现教学资源、金融数据、成果平台的共享，又能实现产学研深度融合。蔡元强还表示，希望加强学校与业界的合作，把量化金融系打造成国内领先、国际有一定知名度的资产管理的高端教育平台和金融科技投资实践的研究平台。

量化金融系的设置，将按照国际最先进的金融学知识体系和实战相结合的办学模式，通过聘请海内外一流基金经理人作为师资队伍，以实战性的，适应高度竞争的教学手段和研究方法来授课。旨在借助浙江工业大学优质的教育教学资源和浙江省国际对冲基金人才协会在金融界的紧密联系，打造的国际顶级的“大数据金融量化实验室”，建设国内领先、国际一流的资产管理高等教育平台和金融科技、投资实践研究平台。为浙江省打造万亿金融产业和培养国内顶尖的金融行

业资管人才贡献力量。

在2017年9月29日，由浙江工业大学和浙江省国际对冲基金人才协会联合打造的国内首个量化金融系在浙江工业大学屏峰校区隆重开班，并举行了首届钱塘江金融港湾量化金融高端论坛。浙江省金融办党组书记丁敏哲、金融研究处处长王永明、地方金融处处长潘广恩、杭州市金融办副主任王建祥、浙江省教育厅高等教育处祝鸿平、浙江工业大学党委书记蔡袁强、副校长虞晓芬、教务处处长计伟荣、学工部部长许伟通、浙江省国际对冲基金人才协会会长施建军、秘书长郭涛、副秘书长杨敏、永安期货副总经理石春生、龙旗科技董事长朱笑慷、原南方基金数量化投资部总监刘治平、上海寻乾投资总经理乔亮、上海君耀投资总经理沈贤能、上海桐湾投资董事长李宏、浙江安诚数盈投资管理有限公司总经理王锋、国信证券经纪事业部总裁杜海江、校内相关学院负责人及第一批入选量化金融系的学生应邀出席。

全国国内首个量化金融系开班预示着协会加强政、校、企联动，充分发挥省对冲基金人才协会的作用，广纳业界师资力量，联合浙江工业大学以优质的师资和先进的培养方式吸引越来越多的优秀学子学以致用，积极投身于浙江经济金融的建设以及中国资产管理行业。省对冲基金人才协会将继续全力支持量化金融系的发展，努力提供师资、资金、平台等方面的支持，并设立奖学金鼓励优秀的学生加入量化金融系。这个系的开设意味着杭州的金融人才培养工作又走在了国内前列。

（二）协会推动 CFA 考场落地杭州

美国特许金融分析师-CFA 考试是国际通行的金融投资从业者专业资格认证，是美国以及全世界公认金融证券业最高认证书，也是全美重量级财务金融机构的分析从业人员必备证书。

2016 年 12 月，浙江省国际对冲基金人才协会为了进一步落实省委省政府关于建设浙江省本地金融人才环境，引进和培养资产管理行业人才的指示，浙江省国际对冲基金人才协会在省政府批示以及省金融办的指导下特邀请全球最大金融专业组织，特许金融分析师协会 CFA 协会全球 CEO Paul Smith 和中国区总裁贾立军来杭州拜访浙江省政府朱从玖副省长，省金融办丁敏折书记等主要领导，由协会秘书长郭涛陪同，拜访工作顺利开展。经过近一年的努力，CFA 考场终于永久落户杭州国博，2017 年 12 月 2 日将迎来该考场的首次考试。由于本次仅开放了 level1 阶段的考试，新考场落户信息也未大范围宣传，本次考生人数近千人，明年 6 月及 12 月参考的考生人数将会大幅提高，预计总数将达到几千人。

考场落地带来了巨大影响：唯一性：CFA 考场落地杭州，此考场是浙江省内唯一的一个考试场地。是集合了浙江全省范围乃至长三角地区的国际化金融人才聚集杭州的考试项目。该考试将成为杭州人才培养、规划、交流的重要平台，助推金融港湾建设，并推动打造“一带一路”人才的高地建设；开放性：面向全国乃至全球考生的考试在杭州落地，也意味着浙江、钱塘江金融

港湾对金融人才建设的开放性和包容性。国际顶尖金融考试在杭州落地不仅推动志于金融行业发展的青年，帮助实现金融梦想，同时助力开创浙江的金融未来。集合国际性协会、高校、企业、本地社团等力量将考场落地钱塘江金融港湾、体现考试权威性、公信力，也是钱塘江金融港湾全面建设中的总布局 and 战略布局中的重大里程碑；专业性：考试内容涵盖了广泛的金融知识，同时考察最新的金融市场相关知识以及金融领域研究成果，也被金融第一考的考试，为全球投资业在道德操守、专业标准及知识体系等方面设立了规范与标准。考试的专业性会为钱塘江金融建设带来无可比拟的国际化推动力，同时为人才培养和建设带来多元化的培育途径；便民性：在杭州未开设考场时，浙江考生都要去上海考试，鉴于考试要求8点半之前要到达考场，绝大部分考生都要选择提前一天到上海住宿，如果按照新设杭州考场每年几千人的规模来算，每年考生节约的往返车费和住宿费在数百万元，切实节约了考生的考试成本和时间。

五、履行宗旨，服务企业，日常机构办实事

浙江作为金融大省，具有投资群体基数大、高净值人群多、风险偏好层次广等显著特点，鉴于我国财富管理行业仍处于发展初期，因此以普惠金融教育为主题的公益讲座——小镇财富讲堂应运而生，由浙江省国际对冲基金人才协会主办、致力于通过知名专家、学者的导读和诠释，分享对财富管理热点话题、财富管理发展趋势、业务创新模式实践的深度思考，为广大普通投资者

带来全新的金融投资基础知识，并帮助投资者在各类金融产品中择优去劣。

在 2017 年度，协会联合会员机构、战略合作方等多家单位共举办小镇财富讲堂 14 场，参会人员达到数千人，取得了良好的普惠金融效果，并得到杭州市萧山区政府、杭州市金融办、杭州市人才协会等多家单位的支持。

（一）“小镇财富讲堂”第十四期： 2017 年股票与债券市场展望与投资机会

由浙江省对冲基金人才协会举办的第十四期小镇财富讲堂活动于 2 月 18 日圆满落幕。活动首先由协会郭涛秘书长重点解读江干区金融政策，同时郭秘书长简单介绍了浙江省对冲基金人才协会成立的背景与战略意义，郭主任富有激情的介绍中洋溢着他对钱塘江金融港湾未来发展的澎湃热情与信心。

世诚投资的陈家琳陈总为大家带来了富有启发性的投资分享，陈总的整个分享紧紧围绕“2017 年股市展望与主题投资机会”这一主题，以周五证监会“新鲜出炉”的非公开发行（定增市场）新规解读切入主题，并阐述了新规的明确影响，并探讨了 A 股市场的判断。

在本次会议上，讲师从多个维度详细分析了这一判断的逻辑，例如适当调控 IPO 发行速度、国家队节奏等。至

整个分享会持续了 3 个多小时，最后郭秘书长总结点评了两位嘉宾的分享，整个研讨会举行得非常成功。很多嘉宾纷纷表示希望协会能举办更多的分享会。

（二）“小镇财富讲堂”第十五期：期权专场

2017年3月5日，由浙江省国际对冲基金人才协会与永安期货联合主办的第十五期小镇财富讲堂在杭州成功举行。本期讲堂以白糖和豆粕两个商品期权即将推出为契机，特邀三位嘉宾，为投资者详解商品期权的交易规则和实操、以及利率期权、奇异期权策略运用。

会议首先由对冲基金人才协会副秘书长、永安期货衍生品发展总部总经理杨敏对协会做了简单介绍。永安期货期权总部培训师邱宁《商品期权业务规则详解》主题演讲，永安期货衍生品发展总部汪宇璐《商品期货账户开设详解》主题演讲，CFA 领望投资管理有限公司投资经理熊赞《利率期权与奇异期权详解》主题演讲。

本次会议主题突出、内容专业，得到了现场客户的广泛好评。会后，到场参会的投资经理、交易员、个人投资者与演讲嘉宾进行了热烈的互动，对商品期权和其策略的运用表现出浓厚的兴趣和期望，对期权策略的产品也进行了探索。

（三）“小镇财富讲堂”第十六期：走进高校

为推进钱塘江金融港湾建设，构建财富管理产业链和新金融生态圈，打造财富管理和新金融创新中心。省政府办公厅提出搭建多领域产业与金融对接平台，推动金融机构与政府间、金融机构与企业间、金融机构间的交流合作。鼓励和支持高校与金融机构、金融企业合作共建创新平台，促进金融创新成果转化。支持开展高端金融交流活动，创建纵向和横向的行业交流对话平台。

浙江省国际对冲基金人才协会作为政府与行业的桥梁，为了进一步落实省委省政府关于建设浙江省本地金融人才环境，引进和培养资产管理行业人才的指示；配合省委省政府关于打造钱塘江金融港湾，增强浙江省在全国证券私募行业的影响力和推广本地优秀私募基金品牌，协会于2017年03月13日，在浙江大学玉泉校区永谦活动中心第二报告厅，在浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司的协办下，开展第十六期小镇财富讲堂活动——走进高校活动。为政府，高校，金融企业以及优秀人才提供一个交流对话平台。

为了配合钱塘江金融港湾建设，为会员单位提供服务，协会的发起单位“浙江玉皇山南对冲基金投资管理有限公司”根据私募管理人的切身诉求，定制化开发了金融量化基础人才招聘平台——“矿石奇才”。基于一个全国性对冲基金人才储备平台，为广大会员单位提供专业、免费、高效的招聘对接服务，更好地发挥人才协会的职能，为浙江省的金融领域发展加砖添瓦。

本次活动受到广大浙大学子的关注，会后学生们纷纷表示希望留在浙江发展，目前的大局势也很适合自己的发展，前来咨询招聘相关事宜，希望协会以后能够代表会员单位进入学校进行招聘。

（四）“小镇财富讲堂”第十七期：量化技术在股市上的应用

由浙江国际对冲基金人才协会主办的第十七期小镇财富讲堂于3月17日在西子国际·华侨基金俱乐部成功举办，本次活动采用闭门邀请模式，有70余位参会嘉宾受邀出席。会议邀请了上海君耀投资管理咨询合伙企业总裁沈贤能博士带来“量化技术在股市上的应用”

主题演讲。

本次讲堂首先由协会秘书长郭涛对协会作简单介绍，本次活动有幸邀请到了江干区金融办施展主任，会中施主任就江干区私募政策，及江干区未来发展方向发表讲话。

接着，沈贤能博士深入浅出地介绍了量化投资的基本设计框架，国内外量化策略的区别，以及君耀投资的基本团队架构、在实际产品运作中如何规避风险、如何适应国内市场条件等方面内容。

这次会议普遍反响较好，现场交流热烈。与会嘉宾非常认可浙江国际对冲人才协会举办这样有意义、有干货的交流研讨会。

（五）“小镇财富讲堂”第十八期：“机器学习在股票市场中的应用”和“期权等衍生品与财富管理”

2017年4月9日，由浙江省国际对冲基金人才协会与永安期货联合主办的第十八期小镇财富讲堂在杭州成功举办。本期讲堂围绕“机器学习在股票市场中的应用”和“期权等衍生品与财富管理”两个主题展开。

会议首先由对冲基金人才协会副秘书长、永安期货衍生品发展总部经理杨敏对历届小镇财富讲堂做了简单介绍。

之后，前海阿比特资本管理有限公司策略架构负责人郭浩翀，作《机器学习在股票市场中的应用》主题演讲。永安期货衍生品发展总部项目经理高渊博，作《期权等衍生品与财富管理》主题演讲。

（六）“小镇财富讲堂”第十九期：通货膨胀下的外汇商品股指 投资机会策略

2017年4月15日，由浙江省国际对冲基金人才协会主办、新加坡交易所协办、永安期货作为活动支持单位的第十五期小镇财富讲堂在杭州成功举行。本期讲堂以近期大宗商品价格持续波动，人民币汇率走向扑朔迷离，A股市场受到美元加息的影响为背景，特邀四位业内资深人士对市场进行深入分析，以及对于新加坡交易所相关衍生品的运用的讲解，使在座听众在迷局中拨云见日、由浅入深的展开讨论。

会议首先由对冲基金人才协会副秘书长、永安期货衍生品发展总部总经理杨敏对协会做了简单介绍。茂隆实业发展总公司首席策略师、辉相投资合伙人许哲首先做了《外汇市场、人民币期货期权的投资运用》的演讲，渣打银行香港铁矿石交易部总监毛嗣文做了《黑色产业链的未来及相关衍生品的应用》主题演讲，杭州动见资产总经理兼投资总监郭谊谦做了关于《新加坡股指期货介绍及套利机会展示》的主题演讲，新加坡交易所上海区总经理陈世亮作为会议的第四位演讲嘉宾以《新交所衍生品掌握中国动向》为主题开展了演讲。

本次会议主题突出、内容专业、讲解生动，得到了现场听众的广泛好评。会后，到场参会的投资经理、交易员、个人投资者与演讲嘉宾进行了热烈的互动，对外汇市场、黑色产业链发展、股指期货以及新加坡交易所相关衍生品表现出浓厚的兴趣。

（七）“小镇财富讲堂”第二十期：“趋势跟踪 CTA 的发展及其优势”和“力量投资美学——事件驱动”

5月7日，由浙江省国际对冲基金人才协会主办，永安期货协办的第二十期小镇财富讲堂在华峰国际22楼大会议室成功举办。本期讲堂围绕“趋势跟踪 CTA 的发展及其优势”和“力量投资美学——事件驱动”两个主题展开。

讲堂首先由上海易善资产管理公司的蔡晨炜蔡博士为大家带来“趋势跟踪 CTA 的发展及其优势”的演讲。接下来由国泰君安证券浙江首席股票分析师，君弘神射手系列投资总监章焯，为投资者带来“股票事件驱动策略”分享。会后参会嘉宾积极发问，与演讲嘉宾进行深入讨论。第二十期小镇财富讲堂圆满落幕。

（八）“小镇财富讲堂”第二十一期：走进高校（二）

2017年5月12日下午，第二十一期小镇财富讲堂之走进高校第二期，于浙江工业大学屏峰校区博易楼5楼报告厅成功举办。为了顺应我国金融产业快速从传统金融向新金融战略转型，打造极富浙江特色的高端财富管理产业链和全球领先的“钱塘江金融港湾”，为浙江省金融产业大发展和战略转型提供强大的人才支撑。在浙江省金融办的指导下，本协会与浙江工业大学强强合作，借助浙江工业大学强大的师资和生源优势，率先在浙工大试点创立资产管理（量化金融）系。浙江工业大学的经贸管理学院副院长李正卫和辅导员叶柱良也出席了本次宣讲会。

沈天瑞博士向学生阐述是量化投资的做法和意义，还具体分析了量化投资所面临的挑战。

同学们对于此次宣讲的内容表现出了极大的兴趣，对资管与未来就业情况踊跃发问，也得到了非常专业和细心的解答。本次招生宣讲会会让工大的同学们对量化投资形成了一个基本的概念和印象，也对这个行业有了基础的认识，不少同学已经跃跃欲试，希望能够在量化金融的道路上开始新的征程。

（九）“小镇财富讲堂”第二十二期：FOF 产品设计及大类资产配置论坛

近年来，FOF 在中国资产管理行业快速发展，对资产进行多元化配置的 FOF 市场潜力巨大、前景广阔。为顺应新政策下资管行业的发展趋势，实现 FOF 发展新业态，7 月 7 日下午，浙江省国际对冲基金人才协会联合国信证券，在杭州新新饭店举办了“FOF 产品设计及大类资产配置论坛”，活动现场介绍 FOF 基金产品设计及大类资产配置方向的选择。

国信证券经济研究所金融工程分析师黄志文为大家介绍了如何运用最优化算法来进行权重配置，分享了债券、商品、股票等不同种类资产配置算法，并对当下大类资产配置方向给出了独家解读。本次论坛在深度交流后落下帷幕。现场很多管理人和投资者都表示收获满满，也期待着下一场更加精彩的论坛。

（十）“小镇财富讲堂”第二十四期：多元资产配置下的新量化对冲

金融是浙江省委、省政府明确打造的八大万亿产业之一，而钱塘江金融港湾则是“十三五”期间浙江金融优化布局、提升高度、增强服务实体经济能力的重要平台。浙江省国际对冲基金人才协会作为浙江省政府重点打造的人才培养、交流、行业互动平台，也将积极响应省委省政府打造“钱塘江金融港湾”的号召，以举办“小镇财富讲堂”的形式，普惠金融教育。

7月18日下午，由浙江省国际对冲基金人才协会主办，华侨基金、华侨国际承办的第二十四期小镇财富讲堂在江干区西子国际31楼如期举行。此次讲堂以“多元资产配置下的新量化对冲”为主题，汇聚了金融及其相关行业内的60余位企业家、商界精英，共同探讨新的历史时期下海内外量化对冲基金呈现的新特点和新趋势。

首先由华侨基金执行总裁王渊致欢迎辞，并对华侨基金做了简单介绍。随后，浙江省国际对冲基金人才协会郭涛秘书长以题为《对冲基金发展的国际新趋势》开始主旨演讲。在场的来宾朋友们表示受益颇多。作为以普惠金融教育为主题的公益讲座——小镇财富讲堂承载着很多使命和意义。

（十一）“小镇财富讲堂”第二十五期：纺织品期货论坛

由浙江省金融办、浙江省金融业发展促进会指导，浙江省国际对冲基金人才协会主办，郑州交易所支持的第二十五期小镇财富讲堂与

8月31日，在杭州剧院路399号万豪酒店成功举办。

本次讲堂以纺织品期货为主题，邀请到了业内专家及纺织测试研究院的讲师，及30余家机构代表。为提升机构投资者对纺织品期货现货市场及期货合约的了解，加强广大投资者能对三季度纺织品期货行情变化分析能力，对冲基金人才协会作为浙江省金融的交流平台，举办了本次讲堂。

讲堂首先由协会副秘书长杨敏致辞，简单介绍了协会的宗旨，及本次活动的办会背景，接下来由第一位演讲嘉宾——永安期货研究中心的杨克贻讲师讲解《全球棉花供需状况》。接着由永安资本农产品部的邓冠迪讲师带来主题为《棉花、棉纱期现合作业务介绍及探讨》的演讲。再由浙江省纺织测试研究院的徐雪飞讲师为大家讲述《棉纱合约质检要素》。最后一位讲师是来自宁波恒逸事业研究部副经理的郭丹，她的演讲主题为《PTA四季度行情展望》。在本次会后来宾们也进行了深度的讨论。

（十二）“小镇财富讲堂”第二十六期：会员专场

第二十六期小镇财富讲堂于10月27日成功举办，本期活动作为浙江省国际对冲基金人才协会的会员专场活动，协会邀请了两位毕马威的合伙人担任演讲嘉宾，与协会会员们分享和探讨了资管时代如何创造增值税管理价值以及全球投资业绩标准（GIPS）介绍和应用难点解析。

演讲中，葛乾达先生对于资管产品增值税相关的法规进行了系统梳理，同时对于资管产品的应税行为进行了深入浅出的论述。

黄小熠先生表示 GIPS 建立了一套全球认可的投资业绩和陈述的标准，确保了准确及一致的投资业绩数据，促进了所有市场进行公平及全球化的竞争，推行业内自我监管的理念。同时黄小熠先生从“公司”、“投资组合”、“组合群”、“数据输入”、“呈报和报告”以及“信息披露”等方面对 GIPS 的主要条款进行了具体讲解。

会后，两位演讲嘉宾和与会人员就相关话题进行了热烈的讨论，分享了专业意见与看法，对财富管理热点话题、财富管理发展趋势、业务创新模式、GIPS 在国内的推广和应用、GIPS 对私募基金有哪些好处等方面进行了深度交流。本次活动的内容丰富且深入，得到了参会嘉宾的广泛认同和积极互动。

（十三）“小镇财富讲堂”第二十七期：量化机构“交想汇”

第二十七期小镇财富讲堂于 11 月 26 日在华浙广场 18 楼顺成功举办。在会议中，我们再次发现，中国这一代企业家和金融家的学习能力非常强，当私募还是国际资本市场中小圈子人的专业词汇的时候，中国各种私募基金如火如荼热闹多年。政府主导、监管先行是中国私募基金行业的基础。

这是宏源期货有限公司加入浙江省国际对冲基金人才协会会员后，第一次合办活动，参会嘉宾反响热烈。会议首先，由宏源期货杭州营业部机构部总经理单伟薇向参会来宾致欢迎辞，并介绍了浙江省国际对冲基金人才协会以及协会主办的小镇财富讲堂系列活动，并表示往后会与协会有更多更深入合办活动的机会。

领川投资管理有限公司投资总监，蔡伟先生通过一段简述，表述

了量化投资是一种由定性分析到定量分析，技术几乎覆盖了投资的全过程，通过全面、系统性的扫描捕捉错误定价、错误估值带来的机会的投资方式。

（十四）“小镇财富讲堂”第二十八期：第十二届金博会“智慧与风控”公益讲堂

作为浙江地区具有广泛影响力的金融业盛会——浙江金融博览会在助力金融服务实体经济、深化金融改革、推动金融创新发展、维护金融稳定等方面发挥了重要作用。

本届金博会主题是“科技引领新金融新财富”，是即将举办的“首届钱塘江论坛”系列活动之一。由浙江省人民政府金融工作办公室指导，杭州运河财富小镇特别主办，浙江省金融发展促进会、浙江省银、证、保、期货各大行业协会、浙江互联网金融联合会、浙江省股权投资行业协会、浙江省对冲基金人才协会、钱江晚报等联合主办。

浙江金融博览会（以下简称“金博会”）已经成功举办了十一届，其品牌影响力不言而喻。作为浙江地区具有广泛影响力的金融业盛会，金博会搭建了金融品牌推广、行业交流、资源对接、投资理财的重要平台，在助力浙江金融深化改革、打开智能化转型新局面、推动金融集聚区踏实发展等方面发挥着极其重要的作用。回顾历届金博会，既是一场观念与思想的砥砺，也是一次财富的聚合与裂变。

12月16日，浙江省国际对冲基金人才协会作为主办方之一，在金博会平行活动的“智慧与风控公益课堂”上率先开讲。浙江省国际对冲基金人才协会邀请到了永安期货衍生品总部的高渊博讲师，从

“资管新规解析”与“2018 宏观集萃”两方面，对到场来宾进行了普惠宣讲。当天天气寒冷，还下着细雨，依然阻挡不住科技的进步步伐。

六、2018 年工作计划

（一）继续发挥好协会的桥梁和纽带作用

为相关政府部门进言献策，反应诉求，并辅助相关部门尽快出台详细的监管政策和指导发展意见，以促进行业的快速、健康发展。为推动浙江省金融万亿产业发展规划和钱塘江金融港湾建设规划，为浙江金融发展提供人才保障，我协会 2017 年的主要工作以及 2018 年的筹备工作得到主管单位省金融办的大力支持，《浙江省金融产业人才发展规划》（浙金融办〔2017〕86 号）文件强调了金融人才发展工作和规划，文件中指出浙江省国际对冲基金人才协会等机构组织在招才引智的作用；强调了浙江工业大学为代表的高校联合我协会开展首个资管专业人才培养的重大影响；支持协会建立量化实验室为代表的金融人才孵化培养基地的探索；鼓励协会及其它单位聚焦全球金融专家而定期开展钱塘江金融高端论坛。

（二）坚持不懈，服务会员

坚持不少于每月一次小镇财富讲堂的特色教育活动，坚持各会员单位以及战略合作方轮流承办的机制，各会员单位分享金融行业的热点探讨坚持讲干货、说真话、说实事的方针和原则，真正达到共同发展的目的。

（三）发挥好协会的监管与督促职能

加强日常走访，逐步建立行业内风险预估机制，走进会员单位并发现各企业在金融、资产管理上存在的问题与风险，同时做好行业自律，增强凝聚力，反对市场操纵。把协会做成行业的标杆，政府智囊，维护行业正常运行，与监管机构针对行业问题进行沟通，为行业争取正常的发展空间。

（四）加强协会建设，提升协会形象

积极扩大行业协会的会员单位数量和覆盖规模，通过活动推广、战略合作方推荐等机制不断引进新的会员单位，同时把控入会门槛，去除存在高风险的企业，同时引导会员单位健康、可持续的发展，提升行业协会的会员数量、公众形象、社会口碑等。

（五）2018年协会计划开展的人才建设项目

1. 建立量化金融实验室

为了培养国际顶尖的金融量化人才，教育基地将以工大资管系为主要依托，联合浙江省工业大学和萧山区政府建立“金融量化实验室”。

实验室将按照华尔街顶级金融机构交易室标准打造。作为金融实验室是培养高端实战人才和进行高水平研究的关键设施，配备了国际通行的交易系统 Wind/Bloomberg/Factset/FTS 等，能够实时传送纽约、伦敦、芝加哥、上海等全球主要金融市场的交易数据，将是国内设施最先进、功能最齐全，集模拟交易和学科研究于一体的综合性

金融实验平台。

实验室以国内第一国，业内最新为目标建设，做到实验室数据可视化，设备科技化和未来感。成为全国媒体乃至国际媒体关注的热点。并得到省市以及中央的关注。

实验室未来与牛津大学协商，共同建立并联合招生。先期邀请牛津大学教授在实验室开展行业前沿的科研项目。做到学术、科研功能的保证。同时，实验室开展的各类人工智能和量化的公开课，每年将培训上万人次，切实在浙江扩大了金融教育的普及。实验室邀请顶级学者来杭州不定期讲学，传播最新的金融理念。国际化的教育基地为引进世界创新人才，培养全球创新金融，Fintech，人工智能和机器学习等新金融手段，打造新财富管理方式，新金融人才，新金融产业。

未来将打造实验室的人工智能与传统投资战略的比赛，以科技与传统的对决为主题，激发社会敏感度，体现实验室的重要性和对行业发展带来的无可比拟的巨大收益。

2. 打造金融人才培养的杭州标准

结合杭州的强项和人才需求在各个细分领域打造培养标准。计划推出与机构合作的全国首个全球交易员的系统培训体系面向浙江省内所有高校符合报考要求的学员、以及已参加工作的具备相应学历资质，同时涉及非金融专业的人员。通过认证的学员通常可向全球衍生品自营交易公司、投资公司、现货贸易集团交易部门、境内外期货公司交易部门或做市部门应聘利率、能源、商品等金融衍生品市场交易、

合规、分析师和投资管理等岗位。

该考试将成为杭州金融类应用人才培养、规划、交流的重要平台，必将助推金融港湾建设，并推动打造“一带一路”人才的高地建设。目前该考试将面向全省在校学生以及社会人士，考试必然要在杭州落地，也意味着浙江、钱塘江金融港湾对金融人才建设的开放性和包容性。在杭州落地不仅推动志于金融行业发展的青年，帮助实现金融梦想，同时助力开创浙江的金融未来。集合国际性协会（CFA 协会）、高校、企业、本地社团等力量将全球交易员资格认证（GLOBAL TRADER PROGRAM）考试推进并落实，体现考试权威性、公信力，也将助推钱塘江金融港湾全面建设中的总布局 and 战略布局的建设和发展。同时独有的金融人才培养的创新性将助力金融效率和金融稳定的平衡，通过金融专才尤其是实战型人才培养的考试制度建设，为金融创新提供更好的环境和土壤，为钱塘江金融港湾建设朝着更有效、更有序、更健康的方向发展做出贡献。

3. 举办千人级别的港湾人才峰会

立足浙江杭州本土，联合上海开展高端钱塘江金融港湾人才峰会，聚焦金融行业人才。将有效克服浙江省金融行业机构与省外乃至海外精英之间的空间隔阂，有助于研究探索基于金融业态的、常态化、市场化的人才项目征集对接机制。

4. 拟在浙江引进落地“工信部金融信息领域急需紧缺人才培养工程”

金融的信息化发展导致金融机构经营方式发生巨大变化，信息技术的广泛应用正在改变着金融行业，包括支付与结算，资金融通与转移，互联网金融，风险管理，大数据，量化金融工程等领域。而这些领域的知识体系还没有完整建立，在此背景下，工信部人才中心在涉及新型工业化发展和信息化建设的重点领域每年培养培训 10 万名急需紧缺人才，其中包括了在金融领域唯一的“金融信息分析系列考试”(FIA, Financial Information Analysis)。该考试将针对金融信息化领域各个部分，开展建立学术委员会，制定标准，课程体系，授课指导和组织考试并颁发工信部的急需紧缺人才证书。

省人才协会与工业和信息化部专业技术人员知识更新工程协调小组办公室协调沟通后建议，把工信部金融信息领域急需紧缺人才培养工程引进浙江作为试点，希望在浙江设立永久考场，每年吸引全国考生来杭州参加考试，打造浙江标准。并同时把工信部人才交流中心“全国金融信息化项目管理办公室”设立在浙江。具体可落地在由省人才协会和省内高校共同在萧山钱江世纪城建立的“钱塘江金融港湾高端人才教育基地”。