

附件：

第十一届期货机构投资者年会方案

一、前言：

境外成熟的期货市场，机构投资者市场成交量超过 80%，占据市场绝对份额。而我国众多有风险管理需求的实体企业和金融机构还远未进入期货市场，大力发展机构投资者、构建以机构投资者为主的期货市场任重而道远。基于此，上海期货同业公会一直致力于期货市场机构投资者的发展工作，并连续 10 年举办期货机构投资者年会。

2010 年第一届年会的主题为“角色和作用”，重在构建期货市场与机构投资者探讨和交流的平台，探讨机构投资者在期货市场当中的重要作用。

2011 年第二届年会的主题为“产品、创新与风险管理”，研究成熟市场机构投资者的衍生品投资策略和运作模式，探讨相关产品设计和风险管理。

2012 年第三届年会的主题为“服务和创新”讨论如何通过创新提升期货行业的服务能力，如何为机构投资者提供优质服务等问题。

2013 年第四届年会以“衍生品市场的财富管理”为主题，针对机构投资者在衍生品市场财富管理中面临的挑战和问题，设置了海外对冲基金管理，IT 技术创新与期货资产管理。场外市场

交易与量化投资四个分论坛。

2014 年第五届年会以“衍生品市场的开放、创新与发展”为主题，探讨期货业国际化，投资策略多元化的议题。

2015 年第六届年会以“经济新常态，市场新动向，监管新政策，投资新航标”为主题，探讨在中国经济结构新常态下，投资者如何解读最新政策，做好投资平衡决策、风险管理及财富管理之道。

2016 年第七届年会以“规范发展，服务实体”为主题，在中国供给侧改革与经济转型背景下，探讨如何缓释经济波动、实现规范发展与服务实体的重要议题。

2017 年第八届年会以“产融共进，转型升级”为主题，探讨产业与金融如何互相融合发展并推进中国经济转型发展的重要议题。

2018 年第九届年会以“立足改革开放，迎接转型挑战”为主题，分论坛主题力求突出各家交易所的优势领域和重要产品。

2019 年第十届年会以“衍生品市场的机构化 多元化”为主题，讨论如何应对期货市场出现的这些新变化，踏上新的征程。

期货机构投资者年会的举办，不仅提供了交流行业发展面临的机遇与挑战的平台，并且有助于加快市场和业务创新，更好地服务实体经济。而且，期货业界会议的举办也有益于提高上海在全球衍生品行业发展方面的话语权。第十一届机构投资者年会将继续承袭往年的专业与传统，进一步扩大期货机构投资者年会的

影响力。

二、年会形式：

本次年会采用线下与线上结合的模式。主论坛：暂定现场会议，时间为半天，致辞领导、演讲嘉宾以及观众邀请到现场，参会人数控制在 200 人以内，同步进行线上直播；分论坛：网络直播，时间为半天，各分论坛同一时间段上线直播。

根据年会期间防疫的要求，严格落实并合理安排参会人数。

三、会议时间：

主论坛：11 月 12 日（周四）9：00

四、主论坛地点：

中国金融信息中心

五、会议主题：

立足本源，创新发展

一直以来，期货行业立足“服务实体经济”本源全面发展。随着近年来期货市场国际化步伐加快、期货市场投资者的多样化、品种多元化，期货行业遇到了全新的发展新机遇，走出一条多元发展、创新发展的蓬勃发展之路。

六、主论坛议程

时间：9：00-12：30

主论坛：立足本源，创新发展

主论坛：立足本源，创新发展		
时间	主题	嘉宾（拟）

9:00-9:10	主持人	上海市期货同业公会会长 陈煜涛
9:10-9:50	领导致辞	中国证监会上海监管局领导 中国期货业协会领导 上海市金融工作局领导 上海期货交易所领导 郑州商品交易所领导 大连商品交易所领导 中国金融期货交易所领导
9:50-10:00	茶歇	
10:00-10:40	2021 年国际关系与经济展望	中国首席经济学家论坛理事长、 植信投资首席经济学家兼研究 院院长 连 平
10:40-11:10	期货衍生品在公募基金管理中的 实践与探索	汇添富基金管理股份有限公司 董事长 李 文
11:10-11:40	保险资管的衍生品投资实践和展 望	太平洋资产管理有限责任公司 副总经理 严赞华
	主持人	上海市期货同业公会监事长 马文胜
11:40-12:30	期货公司的转型与发展	申银万国期货有限公司董事长 李建中 上海东证期货有限公司总经理 卢大印 海通期货股份有限公司总经理 吴红松 光大期货有限公司总经理 俞大伟 国信期货有限公司总经理 余晓东 建信期货有限责任公司总裁 葛文杰

七、分论坛安排：

分论坛均为线上形式，11月12日下午同时在线召开。设六

个分论坛，主题由承办单位根据市场情况进行调整，分论坛议程、嘉宾邀请以及组织直播录制等事宜由承办单位负责，公会统一协调。单个分论坛由 1-2 家期货公司承办。

分论坛 A 主题：“金融科技赋能期货业创新发展”（人工智能和大数据赋能期货业创新发展）

整个金融行业正在经历前所未有的革新。大数据和人工智能的应用正在重塑行业格局。期货行业若不能积极拥抱新的技术，未来的发展前景和将受到明显的制约。国内金融市场对外开放的力度越来越大，海外的竞争对手在金融科技领域已经走在了前面，若是国内的期货公司不能迎头赶上，最终可能面临着被市场淘汰的风险。

分论坛 B 主题：从“心”出发——期货资管主动管理特色之路”

期货资管作为资管市场的后起之秀，转型发展一直在路上。新规后，期货资管回归本源，依托期货公司的天然优势，积极定位产品方向，着力发展自主投资管理业务，走出了一条期货资管的特色之路。论坛将围绕着“期货资管的特色创新投研体系”、“期货资管的运营转型发展”、“衍生品在资管产品中的管理应用”、“发挥期货公司优势，发展期货资管特色”等主题进行。

分论坛 C 主题：不忘初心 开创未来

后疫情时期的结构性投资机会

分论坛 D 主题：商品期权精细化风险管理实务

期权为实体企业和金融机构提供更多元的风险管理工具和更丰富的投资策略组合。同时，实体企业风险管理精细化和多样化需求不断上升，如何应用好期货、期权衍生品工具是非常重要的研究方向

分论坛 E 主题：提升风险管理功能，创新产融服务新模式

2020 年在新冠疫情危机冲击下，全球经济 10 年来首次负增长，中国经济 44 年来首次负增长，但在政策救市刺激下全球货币却严重超发。中美脱钩降低了全球和国内经济运行的效率，增加了摩擦成本。国内农产品期货在 2020 年走出了一波大幅上涨行情，而农业农村部长确表示“要理性看待粮价合理上涨”。那么国内会有通胀之忧吗？疫情期间，期货公司利用“保险+期货”等创新模式助力打赢脱贫攻坚战，助力企业等地区企业平稳经营，不断拓展期货衍生品服务实体经济的深度和广度，期现业务规模不断扩大……由海通期货主办的“提升风险管理功能，创新产融服务新模式”分论坛与您一起探讨。

分论坛 F 主题：聚焦风险管理，创建服务实体新模式

期货市场的本源来自于实体经济对风险管理的需求，经过 30 年的发展，期货市场服务实体经济的能力已经得到了质的提升，基差贸易、期货+保险、仓单融资等各种创新服务手段对实体企业的运营提供了实实在在的帮助。在期货市场成立 30 周年之际，如何围绕风险管理的本源，更大地发挥期货服务实体经济的功能

是期货行业下一个 30 年的重要课题。本分论坛拟从以下几个角度来展开讨论：

- 1、交易所大宗商品交易平台的作用与发展趋势
- 2、市场化运作“期货+保险”的难点和思路
- 3、风险管理子公司业务发展方向探讨
- 4、座谈：期货公司在金融行业的定位及意义

