**“同花顺杯”**

**第二届浙江省大学生证券投资竞赛**

**竞 赛 通 知 附 录**

**浙江省大学生科技竞赛委员会**

**2016年5月**

**附录：**

1. **个人赛评分细则**
2. 账号收益得分

根据竞赛期间账号收益率高低排序，确定排名前100名为获奖范围，通过（100-0.5×名次），转化为收益得分。

1. 账号收益稳定情况得分

对获奖范围内的参赛选手，根据竞赛期间账号每日收益的方差从低到高排序，通过（100-0.5×名次），转化为收益稳定情况得分。

1. 个人赛最终得分

个人赛最终得分=收益得分×80%+收益稳定情况得分×19%+投资逻辑测试参与情况得分×1%

1. 个人赛账号最低交易额

个人赛账号设最低交易额：沪深A股组账号最低交易额为300万，股指期货组账号最低交易额为1000万，证券基金组账号最低交易额为200万。账号交易额不得低于最低交易额。

1. **团队赛评分细则**
2. 投资策略组账号收益得分

根据竞赛期间账号收益率高低排序，通过（100-0.5×名次）的计算方法转化为收益得分。

1. 投资策略组报告评分细则

初赛阶段，专家组评委根据下表对团队提交的初步投资报告进行评分。

决赛阶段，评委根据下表对团队提交的最终投资报告进行评分，按权重计入团队最终得分。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 报告评分要点 | 得分 |
| 选题  总分5分 | 1. 目的明确，具有重要的理论意义和现实意义。能结合所学的课程知识，有很强的能力训练效果。（3-5分） 2. 目的比较明确，具有一定的理论意义和现实意义。能结合所学的课程知识，有一定的能力训练效果。（2-3分） 3. 目的欠明确，具有理论意义和现实意义。能结合所学的课程知识，有能力训练效果。（0-2分） |  |
| 能力水平  总分45分 | 1. 能熟练运用所学知识，充分分析、运用学界的经典前沿资料，有很强的查阅文献及运用文献资料的能力。（11-15分） 2. 能够运用一些相关的研究材料，有一定的查阅文献及运用文献资料的能力。（6-10分） 3. 资料较欠缺，经典和前沿性差，查阅及运用文献资料不足。（0-5分） |  |
| 1. 理论依据充分，数据准确。（11-15分） 2. 理论依据较充分，数据较准确。（6-10分） 3. 理论依据欠缺，数据准确度较差。（0-5分） |  |
| 1. 报告结论具有一定水平，完成策略设计，得出创造性结论，在某些领域获得初步进展，具有一定的学术和使用价值，体现出很好的水平。（11-15分） 2. 提出创新策略，但具体思路仍有考虑不周之处。（6-10分） 3. 策略构建基本没有创新性。（0-5分） |  |
| 成果质量  总分45分 | 报告内容要求策略构建思路清晰，策略完整有效、实事求是。必须围绕选择的策略方向进行研究。（0-5分） |  |
| 1. 策略思路合理，各项指标、结论符合要求。（8-10分） 2. 策略思路较合理，各项指标、结论较符合要求。（5-7分） 3. 策略思路欠缺合理性，各项指标、结论与要求有差距。（0-4分） |  |
| 1. 摘要叙述简练完整，假设合理、问题分析正确、数学或金融用语准确、结构完整，逻辑性严密，层次清晰。（11-15分） 2. 摘要叙述较完整，假设较合理、问题分析较正确、数学或金融用语较准确、结构较完整，有一定的逻辑性和层次性。（6-10分） 3. 摘要叙述较完整，假设较合理、问题分析较正确、数学或金融用语较准确，结构线完整，逻辑不够严密，层次不够清晰。（0-5分） |  |
| 1. 研究报告主要构成部分齐全、合理规范，符号统一，编号齐全。格式，绘图、表格、插图等规范正确，符合论文要求。（8-10分） 2. 基本达到1中的要求。（5-7分） 3. 尚能达到1中的要求。（0-4分） |  |
| 字数不少于1000字，不超过20000字。(0-5分) |  |
| 程序分  总分5分 | 能使用软件编程帮助完成部分策略编写。(0-5分) |  |
| 总分（100分） | |  |

参赛队伍的投资报告成绩按照以下公式计算：

最终报告成绩＝本队报告成绩×（全体参赛队伍报告平均成绩／所在评分专家组报告平均成绩）

1. 量化交易组实测收益评分细则

实测收益得分=（资金收益率×0.8-最大回撤×0.2）×100

最大回撤说明：

最大回撤：以每日结算后资金账号总资金为时间序列样本，在竞赛周期内任一历史时点往后退，样本点走到最低点时的回撤幅度的最大值。例如初始资金为100万，5个交易日结算后资金账号总资金为：

|  |  |
| --- | --- |
| 交易日 | 结算后总资金 |
| 1 | 110 |
| 2 | 150 |
| 3 | 130 |
| 4 | 300 |
| 5 | 120 |

则每个交易日回撤为：

|  |  |
| --- | --- |
| 交易日 | 回撤 |
| 1 | 0/110=0.00% |
| 2 | 30/150=20.00% |
| 3 | 10/130=7.69% |
| 4 | 180/300=60.00% |
| 5 | 0/120=0.00% |

因此最大回撤为60.00%

1. 量化交易报告评分细则

初赛阶段，专家组评委根据下表对团队提交的初步投资报告进行评分。

决赛阶段，评委根据下表对团队提交的最终投资报告进行评分，按权重计入团队最终得分。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 报告评分要点 | 得分 |
| 选题  总分5分 | 1. 目的明确，具有重要的理论意义和现实意义。能结合所学的课程知识，有很强的能力训练效果。（3-5分） 2. 目的比较明确，具有一定的理论意义和现实意义。能结合所学的课程知识，有一定的能力训练效果。（2-3分） 3. 目的欠明确，具有理论意义和现实意义。能结合所学的课程知识，有能力训练效果。（0-2分） |  |
| 能力水平  总分35分 | 1. 能熟练运用所学知识，充分占有和分析学界的经典前沿资料，有很强的查阅文献及运用文献资料的能力。（11-15分） 2. 能够运用一些相关的研究材料，有一定的查阅文献及运用文献资料的能力。（6-10分） 3. 资料比较欠缺，经典型和前沿性差，有查阅文献及运用文献资料。（0-5分） |  |
| 1. 理论依据充分，数据准确，公式推导正确。（8-10分） 2. 理论依据比较充分，数据较准确，公式推导正确度一般。（5-7分） 3. 理论依据欠缺，数据准确度较差，公式推导正确度较差。（0-4分） |  |
| 1. 报告结论具有一定水平，完成策略设计，得出创造性结论，在某些领域获得初步进展，具有一定的学术和使用价值，体现出很好的水平。（8-10分） 2. 提出创新策略，但具体思路尚有待完善和可虑不周之处。（5-7分） 3. 策略构建基本没有创新性。（0-4分） |  |
| 成果质量  总分40分 | 报告内容要求策略构建思路清晰，策略完整有效。策略建模数据要准确、实事求是。必须是围绕选择的策略方向进行研究模型构建，合理使用数据库和量化投资研究平台。（0-5分） |  |
| 1. 模型正确合理，各项指标、结论符合要求。（8-10分） 2. 模型正确，各项指标、结论比较符合要求。（5-7分） 3. 模型较合理，得出各项指标、结论。（0-4分） |  |
| 1. 摘要叙述简练完整，假设合理、问题分析正确、数学或金融用语准确、结构完整，逻辑性严密，层次清晰。（8-10分） 2. 摘要叙述较完整，假设较合理、问题分析较正确、数学或金融用语较准确、结构较完整，有一定的逻辑性和层次性。（5-7分） 3. 摘要叙述较完整，假设较合理、问题分析较正确、数学或金融用语较准确，结构线完整，逻辑不够严密，层次不够清晰。（0-4分） |  |
| 1. 研究报告主要构成部分齐全、合理规范，符号统一，编号齐全。格式，绘图、表格、插图等规范正确，符合论文要求。（8-10分） 2. 基本达到1中的要求。（5-7分） 3. 尚能达到1中的要求。（0-4分） |  |
| 字数不少于1000字，不超过10000字。(0-5分) |  |
| 程序分  总分20分 | 1. 能用软件编程完成策略编写，能在量化投资研究平台上运行，通过历史回验验证策略有效盈利。（14-20分） 2. 能用等软件编程完成策略编写，能在量化投资研究平台上正常运行。（7-13分） 3. 能用软件编程完成策略编写。（0-6分） |  |
| 总分（100分） | |  |

参赛队伍的投资报告成绩按照以下公式计算：

最终报告成绩＝本队报告成绩×（全体参赛队伍报告平均成绩／所在评分专家组报告平均成绩）

1. 现场答辩评分细则

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 评价对象 | 评价内容 | 评分 |
| 1、投资策略 | 投资策略和投资思路阐述。 | 40分 |
| 2、ppt展示 | 运用的幻灯片在讲述团队投资思路时，能否起到增添形象性，梳理逻辑性的作用。 | 20分 |
| 3、应答表现 | 针对评委的提问和建议，应答内容是否清楚准确，应答表现是否沉着得当。 | 40分 |

决赛队伍参加决赛答辩时按照以下公式计算最终答辩成绩：

最终答辩成绩＝本队答辩成绩×（全体参赛队伍答辩平均成绩／所在答辩组平均成绩）

1. 团队赛最终得分
2. 投资策略组最终得分=实测收益得分×20%+投资报告得分×40%+现场答辩得分×40%
3. 量化交易组最终得分=账号收益得分×20%+投资报告得分×40%+现场答辩得分×40%

**三、竞赛平台**

个人赛和团体赛报名成功后，分别采用以下竞赛平台进行模拟交易竞赛。

1. 个人赛股票模块：个人股票模拟交易采用同花顺官方行情手机客户端进行，各参赛选手需在报名后下载并登陆同花顺行情软件，通过交易\模拟炒股\模拟炒股大赛\“同花顺杯”第二届浙江省大学生证券投资竞赛进行比赛。
2. 个人赛股指期货模块：登录竞赛官网进行模拟交易（手机电脑均可）
3. 个人赛基金模块：登陆竞赛官网基金比赛专区进行模拟交易。
4. 团体赛量化交易组：在竞赛官网下载同花顺量化交易软件进行比赛。
5. 团体赛投资策略组：登录竞赛官网进行模拟交易（手机电脑均可）。

**四、竞赛培训**

本竞赛培训分为线上线下两部分：

1. 线上培训：大赛合作平台上将对于量化投资、模型建立等内容进行线上培训，团队赛量化交易组参赛选手可使用分配的账号和密码登录网站观看培训视频（培训视频网站地址在报名平台查询）。
2. 线下培训：2016年6月，竞赛办公室拟进行巡回专题培训。7月，同花顺将于浙江财经大学展开量化交易平台的操作培训，具体事项请密切关注竞赛官网的各类通知。
3. 所有培训均为免费。