

# 大学生智能交易大赛简介

(讨论稿)

## 一、活动背景

随着金融科技的飞速发展，依托算法与人工智能进行自动交易成为一种全新的、高效的交易方式。智能交易作为由电脑根据一定算法程序模拟交易员下单操作进行机器交易的过程，在资金管理、风险控制等方面具有独特的优势。智能交易的核心在于算法，而算法的背后则是精通金融与计算机语言的、具有交叉学科背景的专业人才。

在此背景下，为了培养大学生对于人工智能的兴趣与关注，提高学生的金融科技素养，鼓励学生理论与实践相结合，发掘高校智能交易领域的复合型人才，新华社中国经济信息社将发起大学生智能交易大赛。

## 二、组织机构

**主办单位：**新华社中国经济信息社

**媒体支持：**新华网、新华社客户端、中国金融信息网、《金融世界》

**学术支持：**清华大学五道口金融学院、清华大学经济管理学院、复旦大学经济学院、复旦大学大数据学院、上海交通大学网络空间安全学院、中国科学技术大学管理学院、同济大学电子与信息工程学院、武汉大学计算机学院、华东师范大学经济学院、上海财经大学金融学院、华东理工大学信息科学与工程学院、武汉理工大学计算机科学与技术学院

**全程支持：**银科投资控股有限公司、上海纯达资产管理有限公司

### 三、大赛内容

#### (一) 参赛对象

中国及海外高校在校生（个人或团体均可），特别是金融工程、计算机、财经等专业本科及以上学历的在读学生。参赛选手必须年满16周岁，为在法律范围之内具有民事责任能力的中国公民。

#### (二) 交易标的

交易标的为**商品期货**，包含夜盘交易。商品期货只限于上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所的主力合约和次主力合约品种。

#### (三) 赛程设置

大赛拟于2月1日启动。大赛分为初赛、复赛、总决赛三个阶段。

##### 1、初赛（2月1日-5月9日）

——报名及策略上传阶段（2月1日-4月30日）

初赛阶段，参赛者以**提交策略代码**的形式参赛，详细参赛要求如下：

(1) 按照平台默认的保证金、手续费率、滑点、分钟级别等要求进行回测。

(2) 初赛所使用程序语言没有硬性规定，鼓励使用python，为了保证回测结果的公正性，策略要求在米筐平台进行回测，在初赛当中需提交策略代码至米筐平台。

(3) 为保证比赛公平，所有策略初始资金设定为100万元模拟资金，仓位可任意设定。

(4) 选手须于4月30日前提交一份参赛策略（回测时间为2013年1月1日至2017年12月31日，大赛评委会将任选2年进行回测）；提交后，策略代码将

不能修改，代码仅能进行回测。

#### ——初赛评审（5月2日-5月9日）

根据初赛的评审规则，通过初赛的团队和选手可以进入复赛。在5月9日前公布复赛入选名单，届时会在网站、微信公众号公布初赛结果并短信通知入选团队或个人。

### **2、复赛（5月10日-6月22日）**

#### ——模拟盘阶段（5月10日-6月8日）

该阶段为模拟盘竞赛，经过筛选产生大赛前十六强进入决赛，复赛将不延续初赛的成绩。复赛具体要求如下：

（1）模拟盘跟踪时间为5月10日至6月8日。接到复赛通知的团队或个人可以在5月10日前对初赛的策略代码进行修改。

（2）平台每日会按评审规则公布分数排名。

#### ——复赛评审（6月11日-6月22日）

根据复赛的评审规则，在6月22日前公布决赛入选名单，届时会在网站、微信公众号公布复赛结果并短信通知入选团队或个人。

### **3、总决赛（6月25日-9月上旬）**

#### ——实盘阶段（6月25日-8月22日）

大赛前十六强统一进行实盘操作（选手前两赛段的交易数据全部清零）。实盘操作初始资金统一由纯达资产提供，相应盈亏均由纯达资产承担。

进入决赛的团队和个人可在6月25日前对复赛的策略代码进行修改。

#### ——决赛评审（8月23日-8月26日）

根据决赛的评审规则，在8月26日前公布决赛名次，届时会在网站、微信

公众号公布决赛排名结果。

——决赛答辩会（8月中下旬-9月上旬）

决赛前八强以现场答辩的形式展示策略的思路、逻辑原理等。专家评审对选手和策略的真实性和创新性做考评。

#### 4、颁奖仪式（9月）

大赛主办方将在决赛公布最终获胜者后，举行颁奖仪式。

### 四、参赛规则

#### （一）报名规则

大赛将设置活动专题，新华网、中国金融信息网、银科控股官方网站等均有报名入口。大赛采用实名制网上报名，参赛者须提供有效的身份证件、手机号码等信息登录网站并注册，注册成功后将产生唯一对应的参赛编号和参赛交易账户。一个参赛编号只能提交一套策略代码。

所有成功报名的队伍都将获得大赛提供的专业学习资料、线上培训和专家讲座。报名表须于4月30日前在指定网站提交。一旦报名成功，主办方会下发确认短信。

#### （二）组队规则

1、本次大赛允许团队或个人参赛，可跨专业组队。团队人数原则上不得超过5人。每人仅允许加入一支队伍，不能同时以团队和个人形式参赛。

2、每位团队成员须承担策略模型构建或验证相关工作，不承担建模工作的不能作为团队成员。

3、初赛团体或个人最多可提交1套策略代码。

4、每个参赛主体可邀请一名指导教师。

### **(三) 交易规则**

1、初赛及复赛的初始交易模拟资金为100万元人民币，参赛者通过编写提交的策略代码参加比赛。进入大赛前十六强后采用50万元人民币进行实盘交易。

2、交易不限开仓次数。初赛和复赛的手续费为平台默认设置，实盘期间以账户设置的手续费为准。

3、实盘交易中，亏损率达本金的10%则将被停止交易。

4、实盘阶段最后一个交易日的收盘前，主办方将对选手账户未平仓的仓位进行强制平仓。

5、如主办方发现选手有账户对敲、持仓/成交超限、多账户联动以及其他违反交易规则的异常行为，则直接淘汰，并取消其参赛资格。

6、组委会将为参赛者提供全面专业的实战系统服务。

7、一切交易均应遵守中国证监会等监管机构的相关法律法规，并遵守各交易所的交易规则。

## **五、评审规则**

### **(一) 初赛评审**

1、按照夏普比率（年化收益率/年化波动率）对回测结果进行排名打分，此部分的得分权重占40%。

2、按照年化收益率进行排名打分，得分权重占60%。

3、根据前2项评审标准权重求和进行排名（公式：排名分数=夏普比率排名\*40%+年化收益率排名\*60%），排名分数的数值越小，排名则越靠前，综合排名为大赛整体前80%名次的团队或个人，即可进入复赛。

## **(二) 复赛评审**

- 1、按照夏普比率（年化收益率/年化波动率）对模拟盘结果进行排名打分，得分权重占40%。
- 2、按照年化收益率进行排名打分，得分权重占60%。
- 3、根据前2项评审标准权重求和进行排名（公式：排名分数=夏普比率排名\*40%+年化收益率排名\*60%），排名分数的数值越小，排名越靠前，综合排名前十六强进入决赛。排名在专题页面实时展示。
- 4、到复赛截止日，按照6月8日的最终综合排名选出大赛前十六强。

## **(三) 决赛评审**

- 1、参赛选手如有雷同的策略则取消比赛成绩（先比较实盘交易信号是否一样，再对比策略思路是否雷同）。
- 2、参赛选手的收益率须要大于0。
- 3、按照夏普比率（年化收益率/年化波动率）占40%和年化收益率占60%对实盘策略进行排名；并根据该2项评审标准权重求和进行排名（公式：排名分数=夏普比率排名\*40%+年化收益率排名\*60%），排名分数的数值越小，排名则越靠前。排名在专题页面实时展示。
- 4、决赛排名前八强以现场答辩会的形式展示策略思路，由专家评委现场考评。
- 5、按照决赛实盘排名和答辩会考评综合结果，公布前三名即冠军、亚军和季军。
- 6、参赛者如有指导老师，指导老师也将根据参赛者的比赛名次，获得相应的奖金和奖品。

## 六、奖项设置

各奖项由主办方统一设置，奖金与奖品由银科控股和纯达资产共同提供。

### （一）初赛奖项

初赛通过者，获纪念品一份。

### （二）复赛奖项

前十六名，获颁证书和特制纪念品，及50万元人民币进行实盘决赛。

### （三）决赛奖项

#### 1、获奖选手

冠军1名，20%的实盘收益分成；奖金10万元人民币；可签约成为纯达资产基金操盘手，并可参与基金盈利分成。

亚军1名，20%的实盘收益分成；奖金5万元人民币。

季军1名，20%的实盘收益分成；奖金3万元人民币。

第4到8名优胜者，20%的实盘收益分成。

亚军至第8名优胜者将有机会在新华社中国经济信息社或银科控股实习，参与主办方举办的人工智能交易学术沙龙及相关培训。表现优异者也可正式签约入职银科控股。

#### 2、优秀指导教师

一等奖1名，奖金3万元人民币

二等奖1名，奖金2万元人民币

三等奖1名，奖金1万元人民币

优秀奖5名，银制纪念品