

大连商品交易所文件

大商所发〔2017〕245号

关于举办 2017 年大连商品交易所 “十大期货投研团队”评选的通知

各会员单位：

为支持会员单位加强投研团队的建设，促进期货公司投研能力和产业服务水平的提升，我所将于 2017 年 8 月 28 日-11 月 30 日举办 2017 年大连商品交易所“十大期货投研团队”评选活动。拟参赛团队以期货公司名义报名参加，报名要求、评选规则等相关事项详见附件。

本次评选分为全品种（大商所全部品种）和期权两个评选组，欢迎广大会员单位积极报名参加。

咨询电话：0411-84808251、0411-84808476

联系人：黄丽、侯梦奕

邮箱：sdpx@dce.com.cn

- 附件: 1. 评选方案
2. 团队报名表



分送: 所领导, 存档。

大连商品交易所办公室

2017年8月9日印发

打字: 刘婧婧

校对: 黄丽

共印 170 份

附件 1

大连商品交易所 2017 年“十大期货投研团队”评选方案

第一部分 评选相关事项

一、主办方及评选时间

1. 主办方：大连商品交易所
2. 合作媒体：和讯网、新浪网、期货日报
3. 评选时间表

8 月 28 日-11 月 30 日 开展评选活动

12 月 现场评审会

二、参加要求

1. 拟参赛团队以期货公司名义报名；
2. 每家期货公司最多同时 3 个团队报名；（分为全品种、期权两个评选组，其中期货全品种团队最多 2 个，期权团队 1 个）
3. 每个团队成员 3-6 人，设领队 1 人，须明确各成员在团队中的职责；
4. 团队成员要求一半以上通过期货投资咨询资格考试。
5. 报名时间：2017 年 8 月 9 日-8 月 16 日。
6. 请报名团队填写《团队报名申请表》，并将申请表（word 版）在报名时限内发送邮件至 **sdp@dx.com.cn**，同时将申请

表加盖公司公章和总经理签名后发送扫描件至邮箱，申请获批后即可参加评选。

三、评选奖项

1. 大连商品交易所十大期货投研团队（全品种组，总成绩排名前 10）：10 名；
2. 大连商品交易所优秀期货投研团队（全品种组，总成绩排名 11 - 50）：40 名；
3. 大连商品交易所优秀期权投研团队（期权组，总成绩排名前 10）：10 名。

第二部分 评选规则

本次评选分为全品种和期权两个评选组，评比按照如下四项指标分数进行排名，两组分别进行评比。

一、交易策略报告（30%权重）

1. 每个团队提交的交易策略报告数量不少于 3 篇，**每少一篇扣 5 分**；
2. 每篇报告要求为我所品种相关的交易策略报告，必须具备策略概述、因素分析、风险控制等主要内容；
3. 每个团队需在模拟交易前提交交易策略报告。

二、模拟交易（45%权重）

1. 模拟交易采取 T+0 的交易方式，各团队起始资金 1000

万，各合约保证金、手续费收取标准另行发布；

2. 模拟交易无集合竞价，并采取模拟报单与实际行情**对价对量**的形式成交；

3. 模拟交易按照绝对收益率、夏普指数（收益率均值/收益率标准差）两项指标的综合排名计算分数，两项指标权重各占22.5%，第一名100分，依次减少1分，得分乘以权重计入总成绩，第101名以后成绩为0分；

4. 评选最后一个交易日，模拟交易只可平仓不能开新仓，**且要求所有持仓需全部平仓。**

5. 模拟交易账户亏损超过**20%**，模拟分数为0分。

三、交易策略与吻合度 5 分（5%权重）

1. 要求各团队的交易品种、持仓方向与交易策略基本一致；

2. 交易计划书要求根据交易策略报告，在模拟交易之前或当日提交；

3. 要求品种合约每日持仓方向与提交的最新交易计划保持一致。

四、现场评审 20 分（20%权重）

1. 每个评选组综合得分前15名团队参加现场评审会；

2. 现场评审中，每个团队派代表现场陈述交易策略报告并回答专家提问，专家评审团将根据每个团队的表现现场打分，满分20分；

3. 专家评审团将由期货业内专家、现货专家、媒体代表以及投资客户等组成；

4. 未进入现场评审会的团队，本项得分为现场第 15 名团队的现场得分减 1 分，计入总成绩。

根据各团队上述 4 部分成绩汇总(含策略报告数量扣分项)，确定评选最终获奖名单。

第三部分 其他事项

1. 评选网站及相关媒体每日公开展示参赛团队模拟交易成绩，各团队可自主查询本团队成绩；

2. 活动主办方有权根据实际情况对评选方案进行调整，但不具备向前的追溯力；

3. 如参选团队存在违反规则的行为，主办方有权对相应团队的成绩进行调整，直至取消参评资格；

4. 主办方对本次评选具有最终解释权。

附件 2

2017 年大连商品交易所“十大期货投研团队”评选 团队报名申请表

1. 公司名称：_____

2. 团队名称：_____（如**期货 1 队、**期货 2 队，
区分一家公司的不同团队）

3. 公司简介（要求不超过 150 字）：

4. 团队成员信息表（投资咨询资格请填写编号）

姓名	公司职务	团队角色	从业年限	联系电话	投资咨询证	E-mail
		领队				

5. 团队联系人：

姓名	公司	职务	联系电话	E-mail	QQ

请按以上各项要求填写申请表信息，并于 8 月 16 日 17:00 前将报名申请表发送邮件至 sdpx@dce.com.cn，邮件主题标明“‘十大期货投研团队’评选报名表”，同时将上述申请表加盖公司公章和总经理签名后发送邮件，申请信息获批后即可参加评选。

注：每个参赛团队填写一张报名申请表，请各团队联系人务必加入评选 QQ 群 384367932，关注群内系统测试等相关通知。

联系电话：0411-84808251 黄 丽

0411-84808476 侯梦奕

公司名称（签章）

总经理（签名）

年 月 日