关于举办2018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2018年9月1日-11月30日举办“2018年大连商品交易所十大期货投研团队评选”活动。各会员单位以公司名义组队参加，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： 0411-84808790、0411-84808476

联系人： 李丹、侯梦奕   
 邮箱：sdpx@dce.com.cn

附件: 1.评选方案

2.团队报名表

大连商品交易所

二o一八年八月十六日

附件1

## 大连商品交易所2018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

9月1日-11月30日 开展评选活动

12月 现场评审会

二、参加要求

1、期货公司以投研团队名义均可报名参选；

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、每个团队成员最多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：2018年8月16日-8月21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 **sdpx@dce.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名）：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名）：40名。

3、大连商品交易所十大期权投研团队（期权组总成绩排名前10名）10名；

4、大连商品交易所优秀期权投研团队（期权组总成绩排名11-20名）：10名。

**第二部分 评选规则**

**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）、最大回撤三项指标的综合排名计算分数，**三项指标权重各占22.5%、18%和4.5%**，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。

**四、现场评审20分（20%权重）**

1、综合得分前15名可以参加现场评审会；

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14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天公布前30名团队的成绩，其余团队的成绩不予公布，各团队可以向主办方查询本团队的成绩；

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

**2018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. 公司简介（要求不超过300字）：

3．团队成员信息表（投资咨询资格请填写编号）

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **公司全称** | **团队名称** | **姓名** | **团队角色** | **公司职务** | **联系电话** | **E-mail** | **QQ** | **投资咨询证** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

1. 团队联系人：

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **公司全称** | **团队名称** | **姓名** | **团队角色** | **公司职务** | **联系电话** | **E-mail** | **QQ** | **投资咨询证** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

请按以上各项要求填写申请表信息，[8月21日前将报名申请表发送邮件至sdpx@dce.com](mailto:8月21日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：每个团队填写一张报名申请表。

联系电话：0411-84808790李丹、0411-84808476 侯梦奕

公司名称（签章）

总经理（签名）

年 月 日