**第二届两岸高校期货与期权新秀操盘大赛报名通知**

为了加强两岸交流及进一步加强同学们的实际操盘水平，更好地提高莘莘学子的创新精神和学以致用、知行合一的实践能力，厦门大学经济学院金融系、王亚南经济研究院携手逢甲大学、东吴大学、交通大学（台湾）、武汉大学、中山大学等两岸六所高校以及台湾富邦期货公司举办第二届“两岸高校期货与期权新秀操盘大赛”。

期望通过仿真竞赛，使参赛者拥有完整的金融市场模拟操作经验。尤其通过模拟交易系统，提供实时行情信息系统、模拟交易系统、帐务系统的体验平台，可加强同学对实时信息的敏感度，以及提升同学在交易策略应用之灵活度。除此之外，通过拟真性高的仿真平台交易，可深入了解金融交易特性和方式，进而教导正确之投资观念与风险管理，用以培育更多优秀具有金融操作与风险管理之人才。以模拟竞赛方式，期待能达成教学理论与实务经验的相互印证。

**A. 参赛对象：** 厦门大学在校学生

**B. 活动相关日期**

* + 报名期间：11月8日～11月23日
  + 试用期间：11月19日～11月23日
  + 各校交易平台和交易策略说明会：待确认
* 竞赛期间：第一阶段11月26日～12月14日
* 成绩结算日：12月14日下午15:15分
* 交易策略发表暨颁奖日期：12/22(周六）、地点：厦门大学

**C. 报名方式**

每组2至4人，各校采用单一窗口报名（必须提供小组成员中至少一人的学校电子信箱作为管控）。并由专人统一处理并协助开启活动账号。每校参赛组数上限为150组，额满后即不再受理报名。各组报名完成报名程序，经检视数据无误后直接交付试玩和竞赛的账号密码。

 竞赛网页地址：<http://wise.xmu.edu.cn/options>

 进入竞赛网页地址下载报名表，填写后发送至[jrx@xmu.edu.cn](mailto:jrx@xmu.edu.cn)

**D. 可投资产品**

台湾地区：以台湾金管会证期局公告期货商得受托之商品为主，包含期货和选择权。

大陆地区：大陆各类期货商品。

**E. 竞赛规则**

每组可获得台湾及大陆模拟平台账号各一组，须同时参与两岸模拟交易竞赛，详细活动规则及奖励详见附录1。

**F. 第一阶段选拔**

1. 两岸各校合并计算，取绩效前三名及保障未在前三名之各校1~2名名额，取得参与第二阶段策略发表会资格。

2. 以上同学亦获得推荐进入期货公司实习之机会。

**厦门大学主办单位：**

厦门大学经济学院金融系、厦门大学王亚南经济研究院

**厦门大学承办单位：**

“计量经济学”教育部重点实验室（厦门大学）

**联合主办单位：**

逢甲大学、富邦期货、东吴大学

交通大学、武汉大学、中山大学

5**附录1：竞赛规则**

1. **竞赛内容：**
2. 由各校在学学生组队参赛，每组人数2至4人，每人限报名一组，重复报名者，取消参赛资格。
3. 第一阶段录取队伍参与最后于厦门大学举办的投资策略发表会，发表会将由各校及富邦期货所推派之专业评审评分，作为第二阶段成果发表分数，经加总第一阶段分数后，决选出两岸操盘大赛的优胜者（颁发奖杯及奖金）。

奖金说明：

|  |  |
| --- | --- |
| 名次 | 奖 金 |
| 绩效王 第一名 | 新台币 45,000元(约人民币10,000元) |
| 绩效王 第二名 | 新台币 27,000元(约人民币6,000元) |
| 绩效王 第三名 | 新台币 18,000元(约人民币4,000元) |
| 绩效王 第四名 | 新台币 13,500元(约人民币3,000元) |
| 绩效王 第五名 | 新台币 9,000元(约人民币2,000元) |
| 优胜奖 | 新台币 4,500元(约人民币1,000元) |

1. 报名期间为11/8 至11/23，由各校分别负责其校内的报名事宜，并将报名情形回报给富邦期货及厦门大学，将由专人统一处理并协助开启活动账号，每组可获得台湾及大陆模拟平台账号各一组，并以收到主办单位确认信做为报名成功与否的依据。
2. 试用期间：11/19 (周一)～11/23(周五)
3. 竞赛期间：第一阶段11/26 (周一)～12/14 (周五)
4. 成绩结算日：12/14 (周五)下午15: 15分
5. 原始投资金额：台湾市场：新台币500万 大陆市场：人民币100万
6. 每日收盘后（15:15）进行绩效结算并公告成绩（次日更新），仅以实际持仓计算，挂单部位不予计算，两岸市场账号分别排名计分后，再以各占50%合并加总计算总排名。
7. 有违反下列规定，将进行扣分或取消参赛资格：
8. 使用同学人头户交易者将直接取消参赛资格。
9. 若委请校外人士代为操盘，将视其严重程度进行扣分。
10. 竞赛期间关于交易平台的问题，由富邦期货与厦门大学处理以维持比赛的公平性。
11. 备注事项：
12. 交易期间本金为负时，即自动失去交易资格。实际获利为负者，不列入竞赛排名。竞赛期间分别于两岸市场账号内，至少交易成交50笔以上，委由校方自行复审，复审查核通过方得进入复赛。
13. 如果系统因为任何因素，导致价格错误、延误、撮合机制失效，主办单位得视情形，宣布当天交易无效，并回到前一有效之交易结果。
14. 本竞赛的主要目的是让同学熟悉真实的市场交易机制，竞赛仿真平台已尽量按照实际市场的运作状况设计，请同学不要利用可能存在的系统漏洞进行套利，此行为会影响竞赛成绩。
15. 主办单位保留随时修正、暂停、终止本活动办法之权利。
16. **成绩计算方式：**

1. 第一阶段成绩计算方式：

获利分数\*70% + 风险管理分数\*30% =第一阶段成绩

(1) 获利分数：

* 以最后获利金额作为评分依据。
* 若获利金额小于零，则此项目成绩以零分计算。
* 获利分数计算：以参赛组获利排名占全部参赛组之百分比作为获利分数，例如：A组获利排名为全部参赛组之前25%，则A组获利分数为(100-25)=75

(2) 风险管理分数：

* 以夏普指数（Sharpe ratio）作为评分依据。
* 计算所需的无风险利率为结算日当天公布的1个月银行同业拆借市场利率（大陆采用SHIBOR）。
* 若平均报酬为负，则此项目成绩以零分计算。
* 竞赛期间夏普指数最高者分数以100计算，其余各组计算方式为：

风险管理分数=，取小数点2位后四舍五入。

2. 第二阶段的成绩计算方式：

书面报告占30%＋口头报告占70%＝第二阶段成绩

书面及口头报告评比项目及评分标准说明会时公布。

第二阶段 报告与评比内容规则(稿)

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 评核项目 | 时间分配；内容格式规则 | 比重 | 评比分数 |
| 书面报告： | 格式\*.ppt 10页内，审查内容如下6项，12月19日前交件至各评委，评委于12月21日前评完回寄给主办方富邦期货 [chunchi.c.lin@fubon.com](mailto:chunchi.c.lin@fubon.com) 进行汇整统计。 | 30% |  |
| 口头报告： | 每组报告时间5~6分钟，不足或超时酌情减分。 (或有点评、或Q&A提问，控制3分钟内，每组控制8~10分钟) | 70% |  |
| 每组控制在8~10分钟\*13组＝总计约120分钟。 | | 合计100% | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 【书面汇报】&【路演汇报】：评核项目 | | | |
| 评核项目 | 内容重点提示 | 书面 | 口头 |
| 1.团队合作 | 简述组队缘由、组员介绍、任务分配、、 | 10% | 10% |
| 2.策略逻辑 | 说明竞赛策略、操作逻辑、思路想法、夺奖计划、、 | 10% | 10% |
| 3.资金配置 | 说明资金分配原则、方法方式、动用规则、、 | 10% | 10% |
| 4.标的选择 | 说明商品选择动机、规则、原因、理由、、 | 10% | 10% |
| 5.风险管理 | 说明风险控管方式、例外管理、执行情况、、 | 10% | 10% |
| 6.总结汇报 | 针对此次竞赛经验心得：分别就【两岸】市场以下指定项目，自核自评分析资料报告说明：进出时点、当下动机、心路历程、执行力、致胜关键、可完善之处、、等。   * 两岸账户获利曲线 (附图：横轴-日期；纵轴-净值) * 两岸账户获利曲线A/B比值   + A：净值连续最大获利值；占起始资金%   + B：净值连续最大损失值；占起始资金% | 30% | 30% |
| 临场表现  Q&A | 团队士气、口条逻辑、路演技巧、、或有提问、回复、讲评2~3分钟左右，时间控制酌情加减分。 | ----- | 20% |
| 书审制作 | 书面审查交报时间、内容、编排、美工、、等。 | 20% | ---- |
| 总时数 | 每组控制8~10分钟\*若入选13组=约当要2小时。 | 100% | 100% |

3. 最终排名：

第一阶段分数×70%＋第二阶段分数×30%＝总成绩

* 依第一阶段进入决赛者分数排名，并给予排名重新配分作为第二阶段各组之第一阶段总分。配分方式第一名100分、第二名98分、第3名96分、第4名95分、第5名94分、依名次递减各减1分、、第12名87分、第13名86分。
* 策略发表评分委员将由学界和业界的专业人士所组成（包含富邦期货和各校代表1名）。
* 依各队总成绩作为最终排名。