附件1

**2019年大连商品交易所十大期货投研团队**

**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30日-11月25日 开展评选活动

12月初 现场评审会（另行通知）

二、参加要求

1、由期货公司组队参评，**团队成员可为期货公司及子公司、产业企业及投资机构人员**；

2、每家期货公司最多同时2个团队报名；

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、报名截止日：即日起至2019年8月22日；

5、请报名团队填写《团队报名表》，并将申请表（word版及加盖公章的扫描剑）在报名时限内上传至报名通道http://tytdpx2019.mikecrm.com/528BzRW，若盖章版不能及时上传请发送至邮箱sdpx@dce.com.cn，申请获批后即可参加评选，请团队联系人留意评选QQ群384367932通知信息。

三、评选奖项

1、大连商品交易所十大期货投研团队（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（总成绩排名11－20名）：10名。

3、期权单项奖（期权评比总成绩排名前5名）：不超过5名。

第二部分 评选规则

一、交易策略报告（40％权重，专家评审）

1、满足如下条件的团队入围策略报告评审：（1）评选期间模拟交易累计收益率为正；（2）模拟交易及吻合度加总分数排名前25%；

2、每个团队提交的交易策略报告数量不少于3篇，少于3篇报告，每篇扣5分；（入围期权单项奖评比的团队需至少提交1篇期权策略报告）

3、每篇报告要求为我所品种行情或运行特点的交易策略报告，必须具备策略概述、因素分析、风险控制等主要内容；

4、每个团队需在模拟交易前提交交易策略报告；

5、由3名专家同时对报告进行评价打分取平均值，满分40分。

二、模拟交易（35%权重，系统判断）

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**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20%、10%和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，**且所有持仓需全部平仓**。

5、模拟交易亏损率超过**20%**，模拟分数为0分。

三、吻合度（5%权重，系统加人工判定）

1、要求各团队的交易品种、持仓方向与交易策略和交易计划基本一致；

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%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15名团队的现场得分减1分，计入总成绩。

**根据各团队上述一至四部分成绩汇总以及策略报告数量扣分项，确定评选最终获奖名单。**

**参与期权单项奖评选的团队需满足如下条件：（1）豆粕/玉米期权交易不少于6笔；（2）期权策略报告至少1篇；（3）模拟交易及吻合度排名前30%团队。最终将根据期权策略报告和期权运用进行综合打分，排名前5的团队有资格获得期权单项奖。**

第三部分 其他事项

1、评选网站及相关媒体每天公布参赛团队成绩，各团队可查询本团队成绩；

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。