

浙江省教育厅

浙科竞〔2019〕15号

关于举办浙江省第五届“德邦证券同花顺杯”大学生 证券投资竞赛的通知

各有关高校：

为培养在校大学生证券投资实务能力和金融创新能力，促进校际金融学科交流，有效对接金融业实务部门，助力学生金融创业，打造投资精英团队，经研究决定，举办浙江省第五届大学生证券投资竞赛。现将有关事项通知如下：

一、组织机构

主办单位：浙江省教育厅、浙江省大学生科技竞赛委员会

指导单位：浙江证券业协会

承办单位：浙江财经大学、浙江省大学生证券投资竞赛委员会

协办单位：杭州电子科技大学、浙江核新同花顺网络信息股份有限公司、德邦证券股份有限公司

二、竞赛基本情况

竞赛采用个人竞赛和团体竞赛两种形式。团体竞赛分为投资策略组、量化交易组和市场交易组三个组别，其中投资策略组分本科组和高职组，量化交易组和市场交易组不分本科组和高职组。团队赛决赛地点设在杭州电子科技大学。

（一）个人竞赛

1、个人赛比赛交易标的为沪深A股，起始资金为100万，竞赛以收益率指标进行排名。参赛选手通过证券模拟交易平台进行交易操作，交易规则与真实证券市场相同，交易行情与真实证券市场同步。

2、个人赛分初赛、复赛和决赛三个阶段。账户成交金额大于 10 万的初赛参赛选手进入复赛，资产收益率排名前 200 名的复赛选手进入决赛。

3、个人赛参赛选手独立报名，需填写真实信息，并上传学生证照片。

（二）团队竞赛

团队竞赛分为投资策略组、量化交易组和市场交易组三个组别，每位学生只能参加一个团队，每个团队只能选择一个组别参加竞赛。投资策略组和市场交易组参赛团队由 3 名同一学校在校大学生组成，量化交易组参赛团队由 3 至 5 名同一学校在校大学生组成，每个团队设一位指导老师。

1、投资策略组。比赛内容主要包括撰写投资策略报告、在策略交易平台实现投资策略交易和现场答辩三个环节。

（1）竞赛流程：

分初赛、复赛和决赛三个阶段。由各参赛学校自行组织初赛。

复赛阶段。在截止日期前提交投资策略研究报告（复赛报告），阐述投资思路和投资策略，报告内容可以是上市公司价值分析、行业板块分析、主题投资分析或盈利模式分析等。复赛报告通过审查和查重后，确定决赛入选名单，复赛将淘汰查重相似比高于 30% 的团队。

决赛阶段。入选团队依据投资策略在策略交易平台上进行为期两个月的投资操作，投资绩效计入报告评分，操作结束后提交投资操作分析报告。最终报告由复赛报告和投资操作分析报告组成，由专家组依据实测成绩对最终报告进行评审打分。根据复赛报告评分、投资操作实测报告与复赛报告一致性评分、实测成绩评分三项评分成绩来评出入围一、二、三等奖的团队，入围获奖团队参加决赛现场答辩的团队数根据决赛场地安排情况另行通知。

（2）投资标的：沪深 A 股，起始总资金为 1000 万。

（3）最终得分：由复赛报告评分、投资操作实测报告与复赛报告一致性评分、实测成绩评分和答辩表现四个部分构成，分别以 40%、10%、20%、30% 为权重，加权计算最终得分，并进行名次评定。用于评出入围一、二、三等奖团队的入围得分以最终得分的权重加权计算，答辩表现得分以 0 分计算。

2、量化交易组。比赛内容主要包括撰写量化策略报告、量化交易平台编程及回测、实时数据模拟交易（不允许手动修改或调仓）和现场答辩等环节。

（1）竞赛流程：

分初赛、复赛和决赛三个阶段。由各参赛学校自行组织初赛。

初赛阶段。在截止日期前提交量化投资策略报告（复赛报告），阐述投资思路、量化模型、算法及程序等内容。复赛报告通过审查和查重后，确定决赛入选名单，复赛将淘汰查重相似比高于 30% 的团队。

决赛阶段。入选团队依据量化策略在量化交易平台进行为期两个月的量化交易操作，投资绩效计入报告评分，操作结束后提交量化交易分析报告（包含最终的程序）。最终报告由复赛报告和量化交易分析报告组成，由专家组依据实测成绩对最终报告进行评审打分。根据复赛报告评分、量化交易实测分析报告与复赛报告一致性评分、实测成绩评分三项评分成绩评出入围一、二、三等奖的团队，入围获奖团队参加决赛现场答辩的团队数根据决赛场地安排情况另行通知。

（2）投资标的：沪深 A 股、场内基金、股指期货等，起始总资金为 1000 万。股指期货初始资金分配额可以在量化系统中选择，选定后不能再变更。

（3）最终得分：由复赛报告评分、量化交易实测分析报告与复赛报告一致性评分、实测成绩评分和答辩表现四个部分构成，分别以 40%、10%、20%、30% 为权重，加权计算最终得分，并进行名次评定。用于评出入围一、二、三等奖团队的入围得分以最终得分的权重加权计算，答辩表现得分以 0 分计算。

（4）策略运行期间不允许手动调仓，不能进行人为干预策略。

（5）为保障竞赛策略运行，竞赛官方按照策略数量进行服务器资源的平均分配，对于扫描全市场全数据的策略，将严格限制其服务器资源。技术提供方将安排后台工作人员接受量化交易组团队的咨询。

3、市场交易组。比赛内容主要包括进行证券投资操作、撰写投资总结报告和现场答辩三个环节。

分初赛、复赛和决赛三个阶段。由各参赛学校自行组织初赛。

（1）竞赛流程：

初赛阶段。以个人赛初赛成绩为准，从各参赛高校本校资产收益率排名前列的个人赛选手中挑选人员组成团队，统一由学校组织报名参加复赛。

复赛阶段。团队在指定的投资策略交易平台上进行为期两个月的投资操作，在交易截止日期按综合评分进行排名，前 70% 团队进入决赛。

决赛阶段。入选团队继续进行一个月的投资操作，在交易截止日期提交投资操作分析报告。按三个月的实测成绩综合评分进行排名，并由专家组评审投资操作分析报告。根据投资操作分析报告评分、实测成绩综合评分两项评分成绩评出入围一、二、三等奖的团队，入围获奖团队参加决赛现场答辩的团队数根据决赛场地安排情况另行通知。

(2) 投资标的和限仓：沪深 A 股，起始总资金为 1000 万，单一证券买入持仓不超过总资金的 30%。

(3) 最终得分：由投资操作分析报告评分、实测综合评分和答辩表现两个部分构成，分别以 20%、50%、30% 为权重，加权计算最终得分，并进行名次评定。用于评出入围一、二、三等奖团队的入围得分以最终得分的权重加权计算，答辩表现得分以 0 分计算。

4、竞赛期间，若发现团队提交的模型或投资报告存在抄袭、雷同情况，则由专家组上报竞赛委员会，由竞赛委员会商议决定处理意见。

三、竞赛时间安排

(一) 竞赛报名

个人赛报名截止时间为 2019 年 5 月 31 日，团队赛报名截止时间为 2019 年 6 月 3 日下午 13: 00。

(二) 竞赛时间

1、个人赛：初赛时间为 2019 年 5 月 6 日至 2019 年 5 月 31 日，复赛时间为 2019 年 6 月 3 日至 2019 年 7 月 26 日，决赛时间为 2019 年 7 月 29 日至 2019 年 9 月 12 日。

2、团队赛：

(1) 量化交易组、投资策略组

初赛及复赛：初赛时间为 2019 年 4 月 19 日至 2019 年 5 月 31 日，复赛报告上交截止日期 2019 年 7 月 14 日，复赛审查及查重时间为 2019 年 7 月 15 日至 2019 年 7 月 20 日。

决赛投资操作时间为 2019 年 7 月 22 日至 2019 年 9 月 12 日，投资操作分析报告上交截止日期为 2019 年 9 月 15 日。

现场答辩时间为 2019 年 10 月 26 日。

（2）市场交易组：

初赛时间与个人赛初赛时间相同。

复赛投资操作时间为 2019 年 6 月 10 日至 2019 年 8 月 9 日

决赛投资操作时间为 2019 年 8 月 12 日至 2019 年 9 月 12 日，投资操作分析报告上交截止日期为 2019 年 9 月 15 日。

现场答辩时间为 2019 年 10 月 26 日。

四、竞赛报名与培训

（一）参赛对象

以浙江省普通高校本科、高职高专在校大学生为主展开竞赛。浙江省外高校学生也可通过报名渠道由学校统一组织报名参赛。团队赛参赛队伍需填写参赛报名表，由所属高校教务处盖章后交至竞赛办公室。每个参赛学校需要设定竞赛工作负责人、联络人各一名，负责本校参赛的组织事宜。指导老师必须是参赛队伍所在学校的正式教师，需保证所有队员符合参赛要求。指导老师作为参赛队的代表，负责竞赛参赛活动的相关工作。

（二）报名方法

1、个人赛、团队赛报名。

（1）个人赛各参赛选手需通过手机下载并登陆最新版本“同花顺手机炒股股票软件”App 在线自主报名。

（2）团队赛报名方式，登录竞赛官网（quant.zufe.edu.cn）下载参赛报名汇总表，由参赛学校组织参赛人员填写报名表并由所属高校教务处盖章，纸质文档扫描成 PDF 格式电子版与 EXCEL 电子版一起发送电子邮件至竞赛报名专用邮箱（quant@zufe.edu.cn），邮件主题名称需命名为“学校名称+证券投资竞赛报名名

单”。竞赛办公室收到相关报名邮件后审核参赛资格，审核通过后将分配用户名和密码，参赛人员凭用户名和密码登录官方网站进入比赛。

(3) 未申报过(或有人员变动)竞赛负责人和联系人的参赛高校请登录竞赛官网下载表格，填写后由所属高校教务处盖章，纸质文档扫描成 PDF 格式电子版与 WORD 电子版一起于 2019 年 4 月 26 日(周五)前发送电子邮件至竞赛报名专用邮箱(quant@zufe.edu.cn)，邮件主题名称需命名为“学校名称+竞赛负责人和联系人名单”。

2、竞赛平台：

个人赛和团体赛报名成功后，分别采用以下竞赛平台进行模拟交易竞赛。

(1) 个人赛竞赛平台：沪深 A 股模拟交易采用同花顺手机炒股股票软件 APP 客户端进行。

(2) 团体赛量化交易组：通过竞赛官网进入同花顺 MindGo 量化交易平台进行比赛。

(3) 团体赛投资策略组：通过竞赛官网进入同花顺投资策略交易软件进行模拟交易操作。

(4) 团体赛市场交易组：通过同花顺“股市教练”手机 APP 客户端交易操作。

3、查重平台：

团体赛复赛投资报告将提交 Gocheck 系统进行查重，提交复赛报告前每个团队有两次免费的试查重机会，查重系统登录网站为 <http://www.gocheck.cn/page/login.jsp>。

(三) 报名名额

1、个人赛对各高校不限报名名额，个人赛选手可以同时参加团队赛。

2、团队赛中每个参赛高校参加投资策略组、量化交易组和市场交易组的每个组别队伍数限定不超过 12 支，三个组别的合计队伍数限定不超过 25 支，决赛现场比赛承办方参赛队伍总数增加 5 支队伍组别不限。

(1) 参赛选手只能参加一个团队，每个团队只能参加一个竞赛组别。

(2) 报名截止后，各高校不得再增加参赛队伍数。若个别参赛队伍成员有所调整，必须以加盖本校教务处公章的书面文件向竞赛办公室提出，获得批准后方可调整参赛成员。

(四) 竞赛费用

1、个人赛无需参赛费。

2、团队赛由各高校统一汇总报名，不接受学生单独报名，由参赛学校负责统一交费。参赛费用为每队 600 元，缴费截止时间为 2019 年 6 月 10 日（周一），逾期未交报名费的学校视为放弃竞赛。缴费账户：浙江财经大学，缴费账号：33001616781050001155，开户行：建行杭州文西支行。汇款时在用途栏注明浙江省大学生证券投资竞赛参赛费，要求参赛学校对公转账，不接受个人汇款。汇款后请联系竞赛办公室确认汇款事项。

3、各参赛学生、指导教师的车旅费及住宿费自理。

(五) 竞赛培训

本竞赛培训分为线上线下两部分。

(1) 线上培训：竞赛合作平台上将对于策略投资、量化投资、模型建立等内容进行线上培训，团队赛参赛选手可使用分配的账号和密码登录竞赛网站观看培训视频。

(2) 线下培训：2019 年上半年，拟进行巡回专题培训。并在浙江财经大学开展开放式的投资策略及量化交易平台的操作培训，具体事项请密切关注竞赛官网的各类通知。

(3) 所有培训均为免费。

五、奖励设置

(一) 个人赛不设置省级奖项，获奖证书由业界机构联合颁发，为获奖者提供实习机会或奖品，具体奖项设置另行通知。

(二) 团队赛奖项设置以《浙江省大学生科技竞赛章程》和《浙江省大学生学科竞赛评审工作规程》的规定为准，根据竞赛参赛率（参赛队数与参赛校数比）来确定对应层次的奖项设置，获奖名额与复赛结果同时公示。

六、专家组设置

本次竞赛的专家组成员由浙江证券业协会推荐并经竞赛委员会审核来确定，专家组全部来自证券业界机构部门，专家组负责复赛和决赛的评审。

七、竞赛办公室联系方式

地址：浙江财经大学金融学院楼 302D 室

负责人：徐函

杭州电子科技大学负责人：田穗

竞赛咨询联系人：李泽圣 窦雪研 郑智慧 潘秀菊

联系电话：0571-86754681

邮箱：quant@zufe.edu.cn

微信公众号：ZSIC 官微君

各参赛高校联络人 QQ 群：285794618

参赛指导老师交流 QQ 群：627326386

团队赛队长交流 QQ 群（策略与量化）：765880571

市场交易组组长 QQ 群：636315290

个人赛参赛学生交流 QQ 群：158619226

竞赛信息发布官网：<http://quant.zufe.edu.cn/>

以上时间安排如有调整会及时通知，本通知最终解释权归浙江省大学生证券投资竞赛办公室

附件：

- 1、浙江省大学生证券投资竞赛各参赛高校竞赛负责人和联络人信息确认表
- 2、浙江省大学生证券投资竞赛团队赛报名汇总表
- 3、浙江省大学生证券投资竞赛团队赛评分细则
- 4、2019 年浙江省大学生证券投资竞赛委员会名单

