**附件1：**

赛事指南

一、赛事流程与要求

整个赛事分为初赛、复赛两个阶段。

（一）初赛阶段：2020年11月13日 - 2020年11月31日

网上报名-赛前培训-参赛-网上提交作品-初评-公布入围名单。

（二）决赛阶段：2020年12月1日 - 2020年12月20日

网上提交论文-现场答辩-现场公布大赛结果并颁奖。

**二、竞赛内容**

（一）内容

本次大赛分为初赛和决赛两个部分。初赛为金融建模大赛，主要是利用希施玛数字经济建模与分析平台（简称DEMA），该软件可以使用R、Python、Octave/Matlab三种语言的基本操作。参赛者使用大赛账号即可登陆DEMA软件，参赛者在DEMA上获取赛题及数据链接，在本地调试算法，通过赛题提交入口提交结果。

决赛采用线下PPT演讲和答辩的形式。进入决赛的队伍对模型逻辑进行阐述思路，现场讲解和答辩。

进入决赛的队伍各派出1名代表，各队代表选手对大赛期间的建模策略进行展示，回答评委提问，评委根据综合表现给出分数，并结合初赛成绩最终排名。综合考察学生金融建模能力、知识掌握和运用能力、表达能力、演讲能力、思维能力等综合素质。

（二）竞赛主题

本次大赛的参赛主题是“金融建模”，凡与金融建模相关的研究报告均可参赛。作品需提交基于DEMA量化投资平台的报告一份。

参赛者可选择以下参赛题目中的任意一个：

1.股票资产组合的有效边界的确定与投资组合优化；

2.期权隐含波动率与实际波动率的关系；

3.固定收益证券的定价；

4.上市公司估值，建立企业估值评价体系；

5.企业重大事件（项目）的风险与收益测算：如，企业并购重组、融资项目、极端危机事件等；

6.上市公司会计信息质量评估；

7.行业投资价值分析及投资逻辑；

8.经典主流因子在A股市场的检验；

9.投资者情绪与股票的收益；

10.重大公共卫生事件下的金融市场风险测度建模；

11.股票市场量化对冲策略；

12.基于金融衍生品的套利策略。

**三、评分标准**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **项目** | **作品评分要点（论文：70分+程序：30分=100分）** | **得分** |
| 论文摘要  总分20分 | 参赛作品的摘要部分是对论文研究的背景、内容、方法、结论及意义的一个概括，反映出研究者认识问题解决问题及文字表达的能力。   1. 表达清晰，层次鲜明，模型理论及推导充分严谨，研究结果具有重要的理论意义和现实意义。（16-20分） 2. 表达清晰，层次鲜明，模型理论及推导充分严谨，研究结果具有一定的理论意义和现实意义。（10-14分） 3. 表达欠清晰，模型理论及推导较为充分，能给出一定的研究结果。（0-9） |  |
| 论文能力水平  总分25分 | 模型设计思路清晰，建模实施方案完整。投资策略设计应至少包含投资目标、风险控制、资产配置、绩效评估等投资策略设计的基本内容，体现出金融投资策略的基本要求。   1. 选题背景表达充分、合理，模型的选择有理有据，模型介绍（背景、假设、公式、意义）详细且可读性强和易于理解。内容介绍清晰及层次鲜明，分析步骤安排合理，可读性强，易于理解。结论表达清晰，依据充分，具有积极的理论意义及实践指导意义。（20-25分） 2. 选题背景表达较为充分、合理，模型的选择有理有据，模型介绍（背景、假设、公式、意义）详细且可读性强。内容介绍清晰，分析步骤安排较为合理，可读性强。结论表达清晰，依据充分，具有一定的理论意义及实践指导意义。（10-19分） 3. 选题背景表达不够充分，模型的选择依据欠缺，模型介绍（背景、假设、公式、意义）可读性不强。内容介绍不够清晰，分析步骤安排不够合理且可读性不强。结论表达及依据说明一般。（0-9分）。 |  |
| 论文成果质量  总分25分 | 1. 模型理论依据及推导充分，假设合理，模型选取的指标定义明确、公式清晰、意义明确，如果是统计类的模型，模型及指标的选取需要做假设检验。实验数据准确充分，事实求是，并明确标注数据来源与所使用的分析工具；能够充分利用丰富的绘图形象地表达，实现图文并茂。文本、绘图、表格、插图、引注等格式规范正确。（20-25） 2. 模型理论依据及推导较为充分，假设合理，模型选取的指标定义明确、公式清晰，如果是统计类的模型，模型及指标的选取需要做假设检验。实验数据准确充分，事实求是，并明确标注数据来源与所使用的分析工具。文本、绘图、表格、插图、引注等格式较为规范。（10-19分） 3. 模型理论依据及推导较为充分，模型选取的指标定义及公式较明确。实验数据准确充分，事实求是，并明确标注数据来源与所使用的分析工具。格式较为混乱。（0-9分） |  |
| 程序文件质量  总分30分 | 1. 编程规范，结构合理，注释清晰，程序简洁，可读性强，并且能够正确运行。（25-30分） 2. 编程规范，结构合理，但注释不够清晰，程序运用了大量的For循环，可读性较好，并且能够正确运行。（15-24） 3. 编程规范，但注释不够清晰，程序运用了大量的For循环，可读性较差，同时程序还存在一定的错误。（0-14） |  |
| 总分（100分） | |  |

**四、奖项设置**

（一）校内赛选拔出一等奖、二等奖、三等奖和优胜奖。根据参赛学生队伍规模确定各等级奖项名额，原则上：一等奖不超过参赛总队数的5%，二等奖不超过参赛总队数的15%，三等奖不超过参赛总队数的30%，优胜奖不超过参赛总队数的40%。

（二）根据一等奖团队获奖队伍确定参加全国量化投资赛名单。

五、赛事相关部门及负责人

（一）主办单位

安徽财经大学教务处（创业学院）

（二）承办单位

安徽财经大学金融学院

深圳希施玛数据科技有限公司（协办）

（三）联系方式

联系人：15755884668 钱令涛 18655220578 王老师 18326978202 马老师

大赛QQ交流群：780073342