

附录 1

竞赛规则

(一)竞赛内容:

1. 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。
2. 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 50,000 元(约人民币 10,000 元)
绩效王 第二名	新台币 25,000 元(约人民币 5,000 元)
绩效王 第三名	新台币 15,000 元(约人民币 3,000 元)
优胜奖	新台币 5,000 元(约人民币 1,000 元)

3. 报名期间为 3/17 至 3/28，由各校分别负责其校内的报名事宜，并将报名情形回报宝硕科技及厦门大学，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。
4. 试用期间：4/7 (一)~4/11 (五)
5. 竞赛期间：第一阶段 4/14 (一)~6/13 (五)
6. 成绩结算日：6/13 (五)下午 15: 15 分
7. 原始投资金额：台湾市场：新台币 500 万 大陆市场：人民币 100 万
8. 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。
9. 有违反下列规定，将进行扣分或取消参赛资格：
 - (1) 使用同学人头户交易者将直接取消参赛资格。
 - (2) 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，由宝硕科技与厦门大学处理以维持比赛的公平性。

11. 备注事项：

(1) 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，有成交之委托数据至少 50 笔以上，委由校方自行复审，复审查核通过方得进入复赛。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 主办单位保留随时修正、暂停、终止本活动办法之权利。

(二) 成绩计算方式：

1. 每日成绩计算：

以报酬率为排名依据

报酬率计算方式 = (持有部位价值 + 现金部位) ÷ 竞赛初始金额

2. 第一阶段成绩计算方式：

第一阶段竞赛最后交易日（6/13）计算：

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两岸指标银行公告的一个月定存利率。
- 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：

$$\text{风险管理分数} = 100 \times \left(1 - \frac{\text{夏普指数排名}}{\text{参赛组数}} \right), \text{取小数点 2 位后四舍五入。}$$

3. 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

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，6 月 23 日前交件至宝硕科技 vexch@mail.apex.com.tw，评委于 6 月 27 日前评完回寄给宝硕科技 vexch@mail.apex.com.tw 进行汇整统计。	30%	
口头报告：	每组报告时间约 8~10 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)	70%	
每组控制在 11~13 分钟*8 组=若入选 8 组约 100 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。 ✓ 两岸帐户获利曲线 (附图：横轴-日期；纵轴-净值) ✓ 两岸帐户获利曲线 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	书面审查数据缴交时间、内容、编排、美工等。	20%	----

总时数	每组控制 11~13 分钟*若入选 8 组=约 100 分钟。	100%	100%
-----	---------------------------------	------	------

4. 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。
- 依各队总成绩作为最终排名。