关于举办第十三届广东大学生科技学术节之

第五届广东大学生金融建模大赛的通知

各高校团委、学生会、研究生会：

根据《关于举办第十三届广东大学生科技学术节的通知》（团粤联发〔2019〕11号）要求，现将第五届广东大学生金融建模大赛有关事项通知如下：

一、大赛主题

创新不止步，青春立潮头

# 二、大赛时间

# 2018年4月至6月

# 三、组织机构

# （一）主办单位：共青团广东省委员会、广东省教育厅、广东省科学技术厅、广东省科学技术协会、广东省学生联合会

# （二）承办单位：广东财经大学

# 四、比赛流程

（一）报名

1. 报名时间：即日起至5月10日（星期五）。

2. 报名条件：全省高校全日制在校硕士研究生、本科生、专科生均可以参加比赛，参赛学生的专业和年级不限，可以通过个人或团队方式参加竞赛，团队每队人数不超过3人（要求来自同一个学校），无需缴纳参赛费用。每所高校推荐不超过5份作品。

3. 报名方式和提交作品：各高校团委须在报名时间内将参赛队伍可编辑的Word版和加盖学校团委公章的PDF版的报名表（附件2）、汇总表（附件3，按作品论文推荐顺序填写），以及推荐作品论文报送至指定邮箱xtw@gdufe.edu.cn。邮件命名“XX学校+参赛报名表、汇总表和推荐作品论文”。赛题和参赛作品的具体要求、评分依据见附件1。

（二）评审

1. 初评将于2019年5月13日（星期一）至5月19日（星期日）进行。比赛评委根据参赛队伍上交的推荐作品论文对参赛作品进行量化评分；作品按分数高低依次排名，择优选取不超过50支团队晋级决赛。

2. 决赛以PPT现场演示和答辩方式进行，专家组根据论文评审及现场评分情况决定最终获奖名次。决赛答辩时间拟定于2019年5月26日（星期六）举行。

# 五、奖项设置

面向决赛队伍设置“一等奖、二等奖、三等奖”等奖项，获奖比例为一等奖10%、二等奖15%、三等奖25%。获得二等奖及以上的参赛个人或团队，其指导老师将获得“优秀指导教师”称号。

# 六、联系方式

1. 联 系 人：广东财经大学 郭显军

2. 联系电话：020-84096674

3. 联系地址：广州市海珠区赤沙路21号广东财经大学团委

4. 邮 编：510320

5. 指定邮箱：xtw@gdufe.edu.cn

6. 大赛官方QQ群：877378559（竞赛相关细节和后续事宜将在QQ群进行通知，请高校团委金融金融建模大赛负责人入群）。

第十三届广东大学生科技学术节组委会办公室

（省学联秘书处代章）

2019年4月16日

附件1

第五届广东大学生金融建模大赛

赛题和评分依据

备注：参赛者可以任选1题完成。

一、大赛赛题

1. 选择近3至5年国内、外标的资产数据，设计一个统计套利配对量化金融交易策略。要求该策略要能够动态的跟踪价差的趋势变动，合理地确定开平仓的时机；并从量化策略的收益率波动、贝塔值、最大回撤、阿尔法值、年化收益率、累计收益率、夏普比等方面与基准指数进行比较。

2. 选择近3至5年国内、外标的资产数据，设计一个人工智能机器学习量化金融策略。可选用的人工智能机器学习算法包括：（1）线性回归（2）逻辑回归（3）决策树（4）支持向量机（SVM）（5）朴素贝叶斯（6）K最近邻算法，（7）K均值算法（8）随机森林算法（9）降维算法（10）Gradient Boost和Adaboost算法等一种或多种算法；并从策略的收益率波动、贝塔值、最大回撤、年化收益率、夏普比等方面进行深入分析。

二、评分依据

包括问题背景与分析、模型思路、模型建立、量化策略、模型参数设置、模型测试、效果评价与分析等，并对量化策略的收益率波动、贝塔值、最大回撤、阿尔法值、年化收益率、累计收益率、夏普比等主要指标进行综合评比。

三、作品提交

初赛需提交作品论文（含运行平台说明、测试数据与Python程序代码），论文格式另附。凡未能按照竞赛组委会要求的论文格式（含运行平台说明、测试数据与Python程序代码）提供参赛模型的，将视作弃赛处理。

附件2

第五届广东大学生金融建模大赛

参赛报名表

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 团队名称 |  | | | | | |
| 所选题目 | （填写“1”或“2”） | | | | | |
| 参赛学校 |  | | | 所在地市 | |  |
| 指导教师 | （仅限1人） | | | 手机 |  | |
| 团队成员  （不超过3人）  第1个为组长 | 姓名 | 性别 | 年龄 | 年级、专业 | 联系方式 | |
|  |  |  |  |  | |
|  |  |  |  |  | |
|  |  |  |  |  | |
| 团队联系方式 | 通讯  地址 |  | | | | |
| 邮编 |  | | 邮箱地址 | |  |
| 作品简介  （200字内） |  | | | | | |
| 学校团委  推荐意见 | 学校名称（加盖学校团委公章）：  年 月 日 | | | | | |
| 备注 |  | | | | | |

附件3

第五届广东大学生金融建模大赛参赛汇总表

高校名称（团委签章）： 联系人： 联系方式：

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 推荐顺序 | 队伍名称 | 姓名 | 参赛身份（队长/队员） | 身份证号码 | 手机号码 | 学校 | 专业 |
| 1 |  |  |  |  |  |  |  |
| 2 |  |  |  |  |  |  |  |
| 3 |  |  |  |  |  |  |  |
| 4 |  |  |  |  |  |  |  |
| 5 |  |  |  |  |  |  |  |