

赛题结果提交说明

赛题完成后，结果分为两部分：

第一部分：题目的论文、解题说明文档、附件通过泰迪官网提交。

第二部分：策略的回测报告、MATLAB 源代码、执行脚本说明，调用的外部的代码包（若没有调用，则无需上传），通过 Auto-Trader 的内置的报告上传功能提交。

重要——如何提交第二部分答案：

- a) 策略回测报告生成后，点击**保存绩效报告**，请选择**同步上传策略**；
- b) 若有使用外部函数和数据包，请**手动添加**，并对策略所使用的外部包编写**说明文档**，**同步上传**；
- c) 请登录 [www.digquant.com.cn](http://www.digquant.com.cn) 的，进入**个人中心**，查看**【我的报告】**，最后选择答案相匹配的一份报告提交（点击提交后，策略代码、业绩报告、外部包和说明文档一键完成提交）。
- d) 同一参赛团队中的成员，若有多人或一个人反复提交答案，系统默认以任一团队成员提交的**最后一份**答案为准；提交的策略需与编写论文统一，否则影响比赛成绩。

**\*答案提交操作演示请登录 [www.digquant.com.cn](http://www.digquant.com.cn) 【泰迪杯】中的赛前培训版块查看。**

策略评估说明

Auto-Trader 的回测报告里会通过多个维度对策略进行分析，自动形成打分。

一个优秀的策略可以维持一个可观且稳定的收益，且承受相对较小的风险，收益曲线平滑向上。BP 业绩评估体系 Bitpower 的评分标准具有两大特点，收益与风险并重和多维度综合评分。

我们的评分规则如下：

业 绩 评 估	大维度（权重）	小维度（权重）
	收益风险分析（50%）	纯收益能力（20%）
		风险控制能力（40%）
		风险调整后收益能力（40%）
	进攻防御分析（10%）	进攻能力（50%）

		防御能力（50%）
	绩效归因分析（20%）	配置能力（50%）
		调仓能力（50%）
	持续性分析（20%）	持续盈利能力（100%）

**\*详细的维度指标和计算规则请见附件**

业 绩 评 估	大维度（权重）	小维度（权重）	指标（权重）	标准（待定）
	收 益 风 险 分 析（50%）	纯收益能力 （20%）	年化收益率(80%)	界限为[-25%, 25%], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 1%加 2 分。
			收益均衡性(20%)	以调整 JB 值为准, 界限为[-10, 10], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 1 加 5 分。
		风险控制能力（40%）	年化波动率(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1%减 2 分。
			年化绝对偏差(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1%减 2 分。
			最大潜在亏损率 (10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1%减 2 分。
			最大回撤率(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1%减 2 分。
			最大回撤恢复时间占 总交易时间比(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1 天减 2 分。
			平均回撤率(10%)	界限为[0, 20%], 为 0 计 100 分, 超过 10%计 0 分, 中间每多 1%减 5 分。
			跟踪误差(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1%减 2 分。
			下行波动率(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分, 中间每多 1%减 2 分。
			VaR(10%)	界限为[0, 50%], 为 0 计 100 分, 超过 50%计 0 分,

				中间每多 1%减 2 分。
			溃疡指数 (5%)	界限为[0, 20%], 为 0 计 100 分, 超过 10%计 0 分, 中间每多 1%减 5 分。
			痛苦指数 (5%)	界限为[0, 20%], 为 0 计 100 分, 超过 10%计 0 分, 中间每多 1%减 5 分。
		风险调整后 收 益 能 力 (40%)	夏普比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			Calmar 比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			信息比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			Sterling 比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			Burke 比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			溃疡比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			痛苦比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			Omega 比率 (5%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			Sortino 比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			收益 VaR 比率 (10%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
			收益最大潜在亏损比率 (5%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
	进 攻 防 御 分析 (10%)	进攻能力 (50%)	上行捕获率 (100%)	界限为[-1%, 1%], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。

		防御能力 (50%)	下行捕获率 (100%)	界限为[-1, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.02 加 1 分。
	绩效归因 分析 (20%)	配置能力 (50%)	波动捕获率 (100%)	界限为[0%, 100%], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.01 加 1 分。
		调仓能力 (50%)	调仓相对收益 (100%)	界限为[-25%, 25%], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 1%加 2 分。
	持 续 性 分 析 (20%)	持续盈利能力(100%)	Hurst 指数 (40%)	界限为[0, 1], 以 0.5 为 0 分, 每超过或低于 0.5 的 0.005 计 1 分
			基于收益的统计扫描 量 (30%)	界限为[0, 2.5], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.025 加 1 分。
			R 平方 (30%)	界限为[0, 1], 低于界限计 0 分, 超过界限计 100 分, 中间每多 0.01 加 1 分。