**表3 量化交易报告评分细则**

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 报告评分要素 |
| 策略的创新性和逻辑  20 分 | （1）量化策略在思路或视角上的创新；（0- 5 分）  （2）量化策略在方法运用上的创新；（0- 5 分）  （3）量化策略的逻辑是否正确、严密；（0- 5 分）  （4）投资逻辑是否符合中国市场实践情况。（0-5 分） |
| 策略的设计与阐述  30 分 | （1）量化策略的设计与构建是否完整有效；（0- 5 分）  （2）使用的指标或模型是否科学合理；（0- 5 分）  （3）有合理的风险控制策略；（0- 5 分）  （4）选题目的明确，报告内容与选题一致；（0-5 分） （5）报告主体纲要及内容齐全、合理规范； 摘要叙述简 练完整，报告层次分明、图表规范、专业词汇准确、公  式推导正确；（0- 5 分）  （6）报告字数不少于 1000 字， 不超过 20000 字。（0-5  分） |
| 程序化交易实现  50 分 | 量化策略能用程序化交易实现，并且结果一致。（0- 50  分） |
| 总分 100 分 | |