

# 固定收益外汇商品部业务劳动竞赛

## 需求发布

### 【需求一】

- 1、需求发布日期：2024 年 10 月 16 日
- 2、需求名称：商品期货跨品种套利策略
- 3、需求概述：正如需求名称，本课题是对中国境内商品期货品种设计跨品种套利策略，调仓频率日频及以上，需要考虑滑点（至少万 3）。策略所选品种不设限，但需要考虑流动性（按照月度调整可交易品种，保证策略容量大于等于 40 亿，同时为了保证策略流动性，单品种权重上限设为 0.1）。需自行考虑主力合约切换。要求交易调仓为可实现方式（如白天某段交易时间的平均价等，有夜盘品种不可用结算价，没夜盘品种可用结算价）。因子不设限，但需保证调仓前因子可得，对于基本面因子要注意发布时间。为了保证样本外效果，策略如果涉及模型训练、参数训练，最好考虑按照一定期限进行滚动训练（如每季度重训练）。
- 4、需求发布方：QIS 业务团队
- 5、考核支付标准：50 万
- 6、策略收录标准/评价标准：
  - 1) 测试集日频夏普率不低于 1，训练集和测试集日频夏普率相差不超过 0.3，提交后样本外半年考核的夏普率大于等于 0.9；
  - 2) 测试集长度：月频策略测试集长度至少 5 年，周频策略测试集长度至少 3 年。
- 7、响应方案提交截止日期：需求发布后【4】个月内
- 8、发布方联系人：王康
- 9、信用中心联系人：宋悉瑜

## 【需求二】

- 1、需求发布日期：2024 年 10 月 16 日
- 2、需求名称：美股月频/周频策略
- 3、需求概述：针对美股 ETF 标的（挂钩道琼斯指数、标普 500、纳指 100 或纳斯达克指数等。对于上市时间较短的 ETF 可在 ETF 未上市时间段使用指数本身回测，上市后再用 ETF 替换），基于价量因子或全球宏观数据与美国经济基本面数据等因子，搭建可实操的周频或月频策略模型【仓位为多头或无仓位】。要求交易调仓为可实现方式（如结算价、某段交易时间的平均价等）。需考虑滑点。基本面数据需要保证可定期自动更新，且确保使用数据的时间在发布时间以后，避免使用未来数据。需注意：T 日策略信号出现后，T+1 日完成调仓，T+2 日计算的收益始为调仓后收益。策略需要区分训练集与测试集。
- 4、需求发布方：QIS 业务团队
- 5、考核支付标准：50 万
- 6、策略收录标准/评价标准：
  - 1) 测试集长度至少 5 年。且至少每年需滚动重训练模型；
  - 2) 要求日频计算近五年夏普率不低于 1.5，控制最大回撤 10%以内，在美股下跌的年份策略收益必须高于美股指数本身。提交后样本外半年考核的夏普率大于等于 1.2。
- 7、响应方案提交截止日期：需求发布后【4】个月内
- 8、发布方联系人：王康
- 9、信用中心联系人：宋悉瑜