



QuantNet Contest

20 ноября 2018 г.

Общая информация

QuantNet Contest - это соревнование, которое присуждает награды лучшим торговым алгоритмам, написанным на платформе QuantNet. Целью соревнования является оценка и ранжирование стратегий в зависимости от их эффективности, измеряемой их коэффициентом Шарпа в реальном времени.

Каждый алгоритм, представленный участником в QuantNet Contest и удовлетворяющий критериям, определенным в разделе «Правила», оценивается, ранжируется и может претендовать на выигрыш в зависимости от своего ранга.

Призы назначаются один раз в соответствии с рангом, рассчитанным за период с 1 по 31 декабря 2018 г. включительно.

Участники могут отправлять алгоритмы анонимно без предоставления QuantNet любой личной информации. Единственными необходимыми условиями являются имя пользователя и пароль, выбранные при регистрации в QuantNet.

Фаза оценивания

Фаза оценивания длится с 1 декабря по 31 декабря 2018 г.

Правила

1. Положительная доходность за последние несколько лет

После отправки стратегии оценивается среднесуточный доход за последние 3 года. Если он неположительный, стратегия не принимается к оцениванию и ранжированию на следующих этапах и не участвует в распределении призов.

Среднесуточная доходность за последние 3 года пересчитывается на постоянной основе до последнего торгового дня месяца, и участник может видеть результат. Если скользящая 3-летняя среднесуточная доходность не будет положительной в любой момент в окне между датой отправки и началом оценивания, стратегия по-прежнему будет допущена к следующим этапам оценки. В течение этого льготного периода пользователь может снять свою стратегию и заменить ее другой.

2. Положительная доходность за время тестирования в реальном времени

В конце соревнования рассчитывается среднесуточная доходность за период с 1 по 31 декабря 2018 г. включительно. Стратегия может претендовать на призы, если средний дневной доход за этот период является положительным.

3. Количество отправленных стратегий

Количество отправленных стратегий от одного участника ограничено 20. До фазы оценивания участник может в любое время снять и заменить любую стратегию неограниченное количество раз. После начала оценивания представленный алгоритм больше не может быть заменен.

4. Срок отправки стратегий

Крайний срок отправки стратегий - 8:00 по московскому времени (UTC + 3:00) 1 декабря 2018 г.

Функции для оценивания

Стратегии, которые соответствуют критериям, определенным в разделе «Правила», оцениваются и ранжируются в соответствии с их коэффициентом Шарпа в течение декабря 2018 г.

Рассмотрим временной ряд ежедневных доходностей на этапе оценивания, содержащий N торговых дней и обозначим доходность в момент времени t за r_t . Среднегодовую доходность можно оценить с использованием среднего геометрического значения и доходностей E_N , накопленных за N дней:

$$E_N = \prod_{t=1}^N (1+r_t), \quad R = e^{\frac{\log E_N}{N}} - 1.$$

Пересчитаем в годовом исчислении среднюю доходность M и волатильность V с использованием стандартного отклонения прибыли:

$$M = (1+R)^{252} - 1, \quad V = \sqrt{\frac{1}{N-1} \sum_{t=1}^N (r_t - \bar{r})^2} \sqrt{252}, \quad \bar{r} = \frac{1}{N} \sum_{t=1}^N r_t.$$

Коэффициент Шарпа - это соотношение между средней доходностью и волатильностью:

$$SR = \frac{M}{V}.$$

Призовой фонд

Для призового фонда, равного 2 200 долларам США, призы распределяются следующим образом:

Место	Выигрыш
1	1 000 долларов США
2	600 долларов США
3	300 долларов США
4	200 долларов США
5	100 долларов США

Если количество участников меньше 30, мы оставляем за собой право не присуждать призы. Если количество участников меньше 60, мы оставляем за собой право уменьшить призы для мест со 2-го по 5-й на 50%.

Общие положения

1. Quantnet оставляет за собой право по собственному усмотрению изменять, приостанавливать или прекращать QuantNet Contest, включая, изменение критериев оценки результата, сумм и частоты выплаты призов, правил ранжирования, подсчета очков и периода оценивания в любое время и без предварительного уведомления. QuantNet примет все возможные меры для уведомления всех пользователей через сайт QuantNet о возможных изменениях.
2. QuantNet примет все возможные меры для поддержки пользователей в загрузке стратегий и оценивании их в реальном времени. Ошибки или сбои, вызванные QuantNet и/или пользователями, могут привести к тому, что стратегии не будут загружены и/или оценены в реальном времени. QuantNet не несет ответственности за стратегии, которые не могут быть загружены и/или оценены в реальном времени.
3. Все действующие сотрудники и лица, работающие по договору с QuantNet и/или группой компаний, к которой принадлежит QuantNet, не могут принимать участие в соревновании QuantNet Contest до тех пор, пока обе стороны в явном виде не подпишут соглашение в письменной форме.
4. Если какое(ие)-либо положение(я) этих правил конкурса будет(ут) считаться недействительным(и) или невыполнимым(и), все остальные положения настоящего соглашения остаются в силе.
5. Победители конкурса несут индивидуальную ответственность за уплату любых налогов, которые могут применяться к их призам.
6. Любая попытка обмана в QuantNet Contest, каким его определяет QuantNet по собственному усмотрению, может привести к немедленной дисквалификации участника.
7. Настоящие правила QuantNet Contest регламентируются условиями Положения QuantNet.