

## 可投資屬性是什麼？

### 可投資屬性將潛在策略/ DARWINs做細部的評估呈現

#### 可投資屬性是什麼？

由於多年來對交易策略進行深入研究的結果，可逆屬性(IAs)是Darwinex能夠以最少數量的參數確定交易策略質量的能力的基礎支柱之一。



如果您必須評估交易策略的質量：

- 你會怎麼做？
- 您會考慮哪些因素？
- 您將分析哪些數據？

絕大多數人會回答說，獲利能力決定了戰略的質量。

但是，我們認為結果與實際相去甚遠。

在評估交易策略的質量時，單純的獲利能力可能會扭曲視覺，因為結果可能是純粹的運氣所致，原因是：

- 與交易者能力無關的內在環境。  
這可能是由於一連串的交易，在高波動時期，即使在遭受重大資本損失之後，最終還是變成獲利。
- 外在情況，例如風險管理。

具有“槓桿”交易最賺錢的“財富”，使用“馬丁格爾”的短期系統。

因此，如果盈利能力不是決定策略質量的因素，那麼...

應該怎麼樣？

在Darwinex, 我們通過12種可逆屬性來衡量交易員的技能和才幹, 因此整個投資界可以評估和比較DARWIN, 因為它們都具有相同的風險目標(每月最大VaR值為6.5%)。

此外, 我們不僅提供對策略和DARWIN的完整分析, 而且不在沒有顯示其交易歷史的情況下進行分析, 因此沒有人可以不花任何代價就仿制DARWIN。

運氣是短暫的, 有到期日期。但是, 技能和才能可以永遠持久。

可投資屬性原則

達爾文(Darwinex)的每項真正策略都將由我們的12項“檢測器”進行分析, 並分別授予0至10分。

此外, 它們都要先滿足以下條件:

1. 不相關=>每個屬性都獨立於其餘屬性。
2. 單獨的一種分析屬性不會決定策略的質量。

我們的12種可投資屬性

在本節中, 您將對Darwinex的十二個可投資屬性具有近似的了解。

我們準備了有關它們的特定文章, 因此您可以“私下”見到它們。

1.經驗(例)

經驗可投資屬性(Ex)可衡量DARWIN /交易策略數據的統計顯著性, 得分為0到10。

記錄越多, 其統計可靠性就越高。顯然, 在分析了數十萬筆交易之後, 無法得出相同的結論。

在Darwinex, 我們設計了專有算法, 通過計算DARWIN中具有代表性的決策的數量來衡量體驗(Ex)。

供您參考, “體驗(Ex)”是唯一可以增加直至達到最高分數10的屬性。

我們建議閱讀有關[體驗\(Ex\)](#)的文章, 以了解其背後的邏輯。

2.市場相關性(Mc)

[市場相關性\(Mc\)](#)可投資屬性可衡量DARWIN提供者的交易決策所提供的增加值, 並將結果與其所運營的基礎資產的發展進行比較。也就是說, 它評估DARWIN對基礎資產的依賴性。

較高的等級意味著DARWIN交易對基礎資產的依賴性降低，因為它在兩個市場方向上都進行交易，並且不會長時間保持單一方向。

投資者願意支付DARWIN所獲得回報的20%，因為他認為DARWIN提供者增加了必須獲得回報的價值。

借助Mc，我們可以衡量最終結果的比例是由於該策略在其中運行的基礎資產的內在演變所致。

### 3. 風險穩定性 (Rs)

風險穩定性 (Rs) 衡量DARWIN的基本策略在過去45個交易日中的風險穩定性。分數越高，風險越穩定，因此：

1. DARWIN的行為與其基本策略之間的比例越高，並且
2. DARWIN更有可能以6.5%的VaR目標風險進行交易。

### 4. 風險調整 (Ra)

風險調整 (Ra) 的範圍為0到10，這是我們的風險引擎進行干預的頻率，以保護投資者免受交易者策略中過度風險的影響。

分數越高，我們的風險引擎干預的次數就越少，因此：

1. DARWIN的行為與其基本策略之間的比例越高，並且
2. DARWIN更有可能以6.5%的VaR目標風險進行交易。

### 5. 進場策略 (Os) (進場效率)

開放策略 (Os) 的可投資屬性可以通過早點或晚點系統地開放交易來衡量該策略的執行情況是否更好，並通過將其獲利能力與早點或晚點進入的10個模擬交易的獲利能力進行比較來計算入場質量。晚於交易者。

分數越高，交易者進入市場的決定就越好。

### 6. 出場策略 (Cs) (出場效率)

收盤策略 (Cs) 可投資屬性用於衡量該策略是否可以通過較早或較晚系統地結束交易而表現更好，並通過將其獲利能力與較早退出或提前退出的10個模擬交易的獲利能力進行比較來計算退出市場的質量。比交易者晚一點。

分數越高，貿易商退出市場的決定就越好。

### 7. 正收益一致性 (R+)

正回報一致性(R+) 衡量交易者的交易決策是否遵循可識別的模式，最終以綠色顯示。

R+等級越好，則交易者使用其正頭寸的獲利能力作為平倉的標準的證據就越多。

## 8. 負收益率一致性(R-)

負回報一致性(R+) 衡量交易者在其交易決策中是否遵循可識別的模式(最終以紅色顯示)。

R等級越好，交易者使用其負頭寸損失作為平倉標準的證據就越多。

## 9. 持續時間一致性(Dc)

持續時間一致性(Dc) 衡量交易者是否基於其交易頭寸的持續時間在其交易決策中遵循可識別的模式。

R等級越好，交易者將持倉時間作為平倉標準的證據就越多。

## 10. 損失規避(La)

損失規避(La) 可投資屬性評估交易策略是否表現出對稱行為，而與頭寸成敗無關。

許多交易者表現出無力關閉虧損頭寸，往往會積significant大量虧損，這使市場無法逆轉希望。這些相同的交易者往往傾向於過早關閉獲勝頭寸，過早地獲利。

達爾文(Darwinex)認為，這種行為偏見極其危險，尤其是當它與顯著水平的槓桿作用相結合時。

## 11. 表現(Pf)

績效(Pf) 可投資屬性將DARWIN的風險調整後收益(每月最大VaR最高為6.5%)與風險水平完全相同的10,000個隨機策略的收益進行比較。然後，將它們從1%升至99%的百分位。

其精神類似於夏普/索爾蒂諾比率，但是該實施方案克服了缺點，可以說使夏普/索爾蒂諾不適合評估高風險，高輪換交易策略。

## 12. 資本表現(Cp)

資本表現(Cp) 可投資屬性評估DARWIN的額外投資如何影響DARWIN的投資者回報。

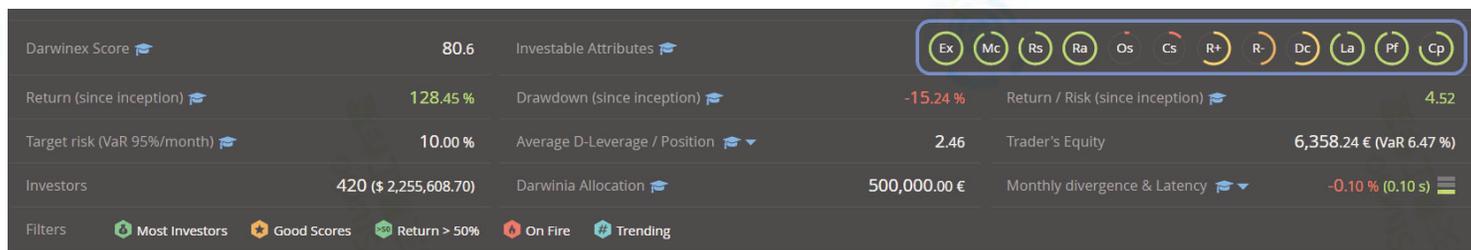
得分越高，DARWIN就越有可能維持大量的投資而不會遭受對投資者造成負面影響的分歧。

在哪裡可以看到它們？

1. 在**DARWIN**主配置文件中
2. 在基礎交易策略配置文件中

可投資屬性部分

在所有DARWIN配置文件的右上部分，您將找到一個帶有12個可投資屬性的部分，並用彩色圓圈將其包圍。顏色根據我們的算法給出的等級而有所不同。



Darwinex Score	80.6	Investable Attributes	Ex Mc Rs Ra Os Cs R+ R- Dc La Pf Cp		
Return (since Inception)	128.45 %	Drawdown (since Inception)	-15.24 %	Return / Risk (since Inception)	4.52
Target risk (VaR 95%/month)	10.00 %	Average D-Leverage / Position	2.46	Trader's Equity	6,358.24 € (VaR 6.47 %)
Investors	420 (\$ 2,255,608.70)	Darwinia Allocation	500,000.00 €	Monthly divergence & Latency	-0.10 % (0.10 s)
Filters	Most Investors Good Scores Return > 50% On Fire Trending				

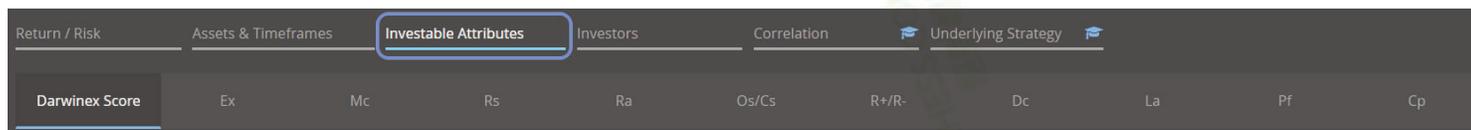
如果將鼠標懸停在圓圈上，您將看到相應的等級以及每個屬性的簡要說明。

另外，通過單擊任意一個，您將打開相應的分析圖。

### “可投資屬性”標籤

在這裡，您可以對可投資屬性進行更詳細的分析，這將使您更加了解DARWIN Provider的質量。

請記住，在每個屬性中，您都會找到一個畢業上限，它將使您進入特定的課程，我們將在其中詳細介紹所有細節。



Return / Risk	Assets & Timeframes	Investable Attributes	Investors	Correlation	Underlying Strategy					
Darwinex Score	Ex	Mc	Rs	Ra	Os/Cs	R+/R-	Dc	La	Pf	Cp