

# اطلاعات طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی اهرمی

25 نوامبر 2024

## نمای کلی طرح سرمایه‌گذاری

نام طرح سرمایه‌گذاری: طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی اهرمی

تاریخ شروع: ۱ دی ۱۴۰۱

دارایی تحت مدیریت (AUM): ۲۴.۸ میلیارد تومان

تعداد واحدها: ۲۴۸۰۰

داده‌های مربوط به عملکرد و استراتژی مشخص شده در این سند، مبتنی بر آزمایش‌های گذشته‌نگر (Backtest) است و نوعی شبیه‌سازی فرضی، از بازده بالقوه طرح سرمایه‌گذاری را نشان می‌دهد. این طرح سرمایه‌گذاری هنوز راه‌اندازی نشده است و همه ارقام فقط برای اهداف توضیحی ارائه می‌شود.

## هدف و استراتژی سرمایه‌گذاری

طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی اهرمی، با سرمایه‌گذاری در رمزارز بیت‌کوین و بهره‌گیری از اهرم، به دنبال بهره‌بردن از بازده‌های زمانی است که قیمت این رمزارز افزایشی است. در عین حال با کنترل اهرم در بازه‌های مجاز تلاش می‌شود زیان وارده به طرح سرمایه‌گذاری در دوره‌های نزولی بازار کنترل شود.

## خلاصه عملکرد

داده‌های عملکرد که در ادامه ذکر شده است، از یک استراتژی تستی گرفته شده است و عملکرد واقعی را منعکس نمی‌کند. این طرح سرمایه‌گذاری در حال حاضر فعال نیست.

طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی اهرمی (گذشته‌نگر)

- بازده سالانه: ۲۷۹.۵۹٪
- میانگین بازده هفتگی: ۳.۴۵٪

## معیارهای ریسک

- نوسانات (انحراف معیار هفتگی): ۱۲.۸۷٪
- ارزش به ریسک<sup>۱</sup> (VaR) پرتفوی: ۲۳.۱۴٪
- نسبت شارپ<sup>۲</sup> هفتگی (Sharpe Ratio) پرتفوی: ۰.۲۶۸
- نسبت شارپ هفتگی (بیت‌کوین): ۰.۲۸۷

<sup>۱</sup> به معنای آن است که با 95 درصد اطمینان، انتظار می‌رود که بیشترین زیانی که یک دارایی یا پورتفوی می‌تواند در یک بازه زمانی مشخص (در اینجا هفتگی) متحمل شود، 11.9 درصد از ارزش کل آن باشد

<sup>۲</sup> این شاخص نشان می‌دهد که یک طرح سرمایه‌گذاری به ازای ریسک‌های اضافی‌ای که سرمایه‌گذار متحمل شده، چه میزان بازده اضافی تولید کرده است.

• حداکثر افت<sup>3</sup> (Maximum Drawdown) پرتفوی: ۵۳.۱۳٪

• حداکثر افت (بیت‌کوین): ۲۶.۱۸٪

## تخصیص دارایی‌های طرح سرمایه‌گذاری

در حال حاضر این طرح سرمایه‌گذاری به شکل انحصاری در بیت‌کوین سرمایه‌گذاری می‌کند.

### تیم مدیریت

این طرح سرمایه‌گذاری توسط تیم کوانت در شرکت داراویس مدیریت می‌شود. این تیم حرفه‌ای، به طور فعال بر بازار ارزهای دیجیتال نظارت دارد تا ضمن مدیریت ریسک، در روندهای رو به رشد بازار سرمایه‌گذاری کنند. این تیم از تجزیه و تحلیل کمی و تکنیکال برای اتخاذ تصمیمات سرمایه‌گذاری آگاهانه استفاده می‌کند.

### کارمزدها و هزینه‌ها

- کارمزد مدیریت (سالانه): سالانه ۵ درصد
- هزینه بهره (سالانه): متغیر بین ۶ الی ۱۰ درصد

### اطلاعات حقوقی و مقرراتی

نتایج عملکرد فرضی است و نباید به عنوان عملکرد واقعی یا آتی این طرح سرمایه‌گذاری در نظر گرفته شود. عملکرد گذشته، چه واقعی باشد و چه آزمایش شده، نتایج آینده را تضمین نمی‌کند. سرمایه‌گذاری در ارزهای دیجیتال، ریسک قابل توجهی را به همراه دارد و ممکن است منجر به از دست دادن سرمایه شود.

### ریسک بازار

این طرح سرمایه‌گذاری منحصر از بیت‌کوین تشکیل شده است که به عنوان رمزارز با بیشترین ارزش بازار نسبت به سایر رمزارزها با ثبات است. با این حال، بازار رمزارز به شکل تاریخی نوسان بالایی دارد و استفاده از اهرم موجب تشدید اثر این نوسانات می‌شود. سرمایه‌گذاران باید برای نوسانات احتمالی در بازار، به ویژه در زمان نوسانات شدید، آماده باشند.

### سلب مسئولیت

داده‌های عملکرد طرح سرمایه‌گذاری که در این سند ارائه شده، بر اساس تست‌های گذشته‌نگر از استراتژی از پیش تعریف شده است. عملکرد گذشته‌نگر فرضی است، شرایط واقعی بازار را در نظر نمی‌گیرد و نمی‌تواند نتایج آینده را پیش‌بینی کند. طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی اهرمی، در حال حاضر، در حال توسعه است و هنوز برای سرمایه‌گذاری در دسترس نیست. ارقام عملکرد صرفاً برای اهداف نمایشی ارائه شده‌اند.

---

<sup>3</sup> این شاخص بیشترین کاهش درصدی ارزش یک پرتفوی یا دارایی، از اوج ارزش خود تا پایین‌ترین نقطه را در یک دوره زمانی مشخص نشان می‌دهد.

تست‌های گذشته‌نگر شامل محدودیت‌های ذاتی بسیاری است، از جمله استفاده از داده‌های شبیه‌سازی‌شده بازار، فرضیات ایده‌آل و ناتوانی در نظر گرفتن تمام عوامل بازار، از جمله محدودیت‌های نقدینگی و معاملاتی است. نتایج واقعی ممکن است به طور قابل‌توجهی با آنچه در این سند نشان داده شده، تفاوت داشته باشد.