

## اطلاعات طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی طلا

20 نوامبر 2024

### نمای کلی طرح سرمایه‌گذاری

نام طرح سرمایه‌گذاری: طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی طلا

تاریخ شروع: ۱ دی ۱۴۰۱

دارایی تحت مدیریت (AUM) اولیه: 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 طلا، با سرمایه‌گذاری در سبدهی متشکل از رمزارزهای مرتبط با طلا و دارایی بدون ریسک، برای به حداکثر رساندن بازده در عین کنترل ریسک استفاده می‌کند. پرتفوی به صورت هفتگی مجدداً بالانس می‌شود تا در عین همراهی با روندهای بهینه بازار طلا، ریسک را مدیریت کند.

### 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 با طلا (گذشته‌نگر)

- بازده سالانه: ۱۴.۳۹٪
- میانگین بازده هفتگی: ۰.۲۷٪

### معیارهای ریسک

- نوسانات (انحراف معیار هفتگی): ۹.۶٪
- ارزش به ریسک<sup>۱</sup> (VaR) پرتفوی: ۱.۷٪
- نسبت شارپ<sup>۲</sup> (Sharpe Ratio) پرتفوی: ۰.۲۰
- نسبت شارپ (طلا): ۰.۲۰

<sup>۱</sup> به معنای آن است که با ۹۵ درصد اطمینان، انتظار می‌رود که بیشترین زیانی که یک دارایی یا پورتفوی می‌تواند در یک بازه زمانی مشخص (در اینجا هفتگی) متحمل شود، ۱.۷ 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: ۷.۶۲٪

- حداکثر افت (طلا): ۱۰.۷۲٪

### تخصیص دارایی‌های طرح سرمایه‌گذاری

دارایی‌های درون طرح سرمایه‌گذاری در تاریخ 24 آبان بر اساس «نام دارایی»، «علامت اختصاری» و «وزن دارایی» مشخص شده‌اند:

وزن	علامت اختصاری	دارایی
۶۵٪	PAXG	طلا
۳۵٪	USDT	تتر

### 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 و به طور هفتگی سبد را مجدداً بالانس می‌کنند 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

- کارمزد مدیریت (سالانه): مجموعاً سالانه ۲.۵ درصد
- کارمزد عملکرد: سالانه ۲۰ درصد از بیش از ۱۸ درصد بازده مثبت

### 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 عمدتاً از استیبل‌کوین‌ها و رمزارزهای مرتبط با طلا تشکیل شده است که در مقایسه با پرتفوی‌های رمزارزی معمولی، نسبتاً پایدار هستند و در برابر افت احتمالی شدید در ارزش طلا بیمه شده است. با

<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.

این حال، سرمایه‌گذاران همچنان 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 کم‌ریسک، در حال حاضر، در حال توسعه است و هنوز برای سرمایه‌گذاری در دسترس نیست. ارقام عملکرد صرفاً برای اهداف نمایشی ارائه شده‌اند.

تست‌های گذشته‌نگر شامل محدودیت‌های ذاتی بسیاری است، از جمله استفاده از داده‌های شبیه‌سازی شده 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.