

## اطلاعات طرح سرمایه گذاری کریپتویی با ریسک متوسط

28 اکتبر 2024

### نمای کلی طرح سرمایه گذاری

نام طرح سرمایه گذاری: طرح سرمایه گذاری کریپتویی با ریسک متوسط

تاریخ شروع: ۱ دی ۱۴۰۱

دارایی تحت مدیریت (AUM) اولیه: ۸۳.۴ میلیارد تومان

تعداد واحدها: ۸۳۴۰۰

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 سرمایه گذاری را نشان می‌دهد. این طرح سرمایه گذاری هنوز راه‌اندازی نشده است و همه ارقام فقط برای اهداف توضیحی ارائه می‌شود.

### هدف و استراتژی سرمایه‌گذاری

طرح سرمایه گذاری کریپتویی با ریسک متوسط، با سرمایه‌گذاری در سبدی متنوع متشکل از ۴۰ درصد استیبل‌کوین، ۲۰ درصد ارزهای دیجیتال با ارزش بازار بالا، ۲۰ درصد ارزهای دیجیتال با ارزش بازار متوسط و ۲۰ درصد طلا، بازده متوسطی به سرمایه‌گذاران ارائه می‌کند. برای حفظ تعادل بین ریسک و بازده بهینه، پرتفوی ماهانه مجدداً بالانس می‌شود.

### 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 سرمایه گذاری در حال حاضر فعال نیست.

طرح سرمایه گذاری کریپتویی با ریسک متوسط (گذشته‌نگر)

- بازده سالانه: ۱.۲۵٪
- میانگین بازده هفتگی: ۱.۲۵٪

### معیارهای ریسک

- بتا<sup>۱</sup>: ۰.۹۵
- نوسانات (انحراف معیار هفتگی): ۳.۸٪
- ارزش به ریسک<sup>۲</sup>: ۹۵٪ : ۴.۵٪

<sup>۱</sup> معیاری برای سنجش نوسانات یک دارایی یا طرح سرمایه گذاری سرمایه‌گذاری نسبت به کل بازار است. بتای برابر با ۱ به معنای همبستگی کامل با بازار است، در حالی که بتای بالاتر از ۱ نشان‌دهنده نوسانات بالاتر و بتای کمتر از ۱ نشان‌دهنده نوسانات پایین‌تر است.  
<sup>۲</sup> VaR 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، ۳.۲ درصد از ارزش کل آن باشد

- نسبت شارپ<sup>3</sup> : ۱.۴۶
- حداکثر افت<sup>4</sup> (۶) (Max Drawdown ماه): -۱۵.۴%

### ترکیب پورتفوی

طرح سرمایه گذاری کریپتویی با ریسک متوسط از ۴۰ درصد استیبل کوین، ۲۰ درصد ارزهای دیجیتال با ارزش بازار بالا، ۲۰ درصد ارزهای دیجیتال با ارزش بازار متوسط و ۲۰ درصد طلا تشکیل شده است. برای اطمینان از تنوع و ثبات، پرتفوی هر ماه دوباره بالانس می‌شود.

### تخصیص دارایی‌های طرح سرمایه گذاری

در ادامه، دارایی‌های درون طرح سرمایه گذاری بر اساس «نام دارایی»، «علامت اختصاری» و «وزن دارایی» مشخص می‌شود.

|              |       |              |
|--------------|-------|--------------|
| Tether USDt  | ۳۰    | Tether USDt  |
| PAX Gold     | ۲۰    | PAX Gold     |
| Bitcoin      | ۱۴.۵۷ | Bitcoin      |
| USDC         | ۸.۶۶  | USDC         |
| Ethereum     | ۳.۲۷  | Ethereum     |
| Dogecoin     | ۳.۱۷  | Dogecoin     |
| TRON         | ۲.۲۵  | TRON         |
| Toncoin      | ۱.۹۸  | Toncoin      |
| Cardano      | ۱.۸۳  | Cardano      |
| Avalanche    | ۱.۶۲  | Avalanche    |
| Shiba Inu    | ۱.۵۷  | Shiba Inu    |
| Dai          | ۱.۳۴  | Dai          |
| Bitcoin Cash | ۱.۰۹  | Bitcoin Cash |

<sup>3</sup> Sharpe Ratio : این شاخص نشان می‌دهد که یک طرح سرمایه گذاری به ازای ریسک‌های اضافی‌ای که سرمایه‌گذار متحمل شده، چه میزان

بازده اضافی تولید کرده است

<sup>4</sup> این شاخص بیشترین کاهش درصدی ارزش یک پورتفوی یا دارایی، از اوج ارزش خود تا پایین‌ترین نقطه را در یک دوره زمانی مشخص نشان

می‌دهد

|               |      |               |
|---------------|------|---------------|
| Chainlink     | ۱.۰۸ | Chainlink     |
| Polkadot      | .۹۵  | Polkadot      |
| BNB           | .۹۴  | BNB           |
| Solana        | ۰.۹  | Solana        |
| NEAR Protocol | ۰.۸۱ | NEAR Protocol |
| Litecoin      | ۰.۸۱ | Litecoin      |
| Sui           | ۰.۷۹ | Sui           |
| Aptos         | ۰.۷۴ | Aptos         |
| Uniswap       | ۰.۷۱ | Uniswap       |
| Pepe          | ۰.۶  | Pepe          |

### تیم مدیریت

این طرح سرمایه گذاری توسط تیم کوانت در شرکت داراویس مدیریت می‌شود. این تیم حرفه‌ای، به طور فعال بر بازار ارزهای دیجیتال نظارت دارد و مدل‌های کمی پیشرفته را برای مدیریت سبد به کار می‌برد. این سبد به صورت مجدداً بالانس می‌شود تا ضمن مدیریت ریسک، در روندهای رو به رشد بازار سرمایه‌گذاری کنیم و در عین حال ریسک را به حداقل برسانیم. با استفاده از تحلیل کمی و تکنیکال، ما اطمینان حاصل می‌کنیم تا تصمیمات سرمایه‌گذاری را آگاهانه و مبتنی بر داده‌ها اتخاذ کنیم که بر بهینه‌سازی بازده در پارامترهای ریسک طرح سرمایه گذاری کریپتویی با ریسک متوسط، متمرکز است.

### 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 سرمایه گذاری 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 سرمایه گذاری عمدتاً از استیبل کوین‌ها، ارزهای دیجیتال با ارزش بازار بالا و متوسط تشکیل شده است که در مقایسه با پرتفوی‌های پرریسک، نسبتاً پایدار هستند. با این حال، سرمایه‌گذاران همچنان باید برای نوسانات احتمالی در بازار، به ویژه در زمان رکود، آماده باشند.

### **سلب مسئولیت**

داده‌های عملکرد طرح سرمایه گذاری 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 سرمایه گذاری 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، مانند محدودیت‌های نقدینگی و هزینه‌های معاملاتی است. نتایج واقعی ممکن است به طور قابل‌توجهی با آنچه در این سند نشان داده شده، تفاوت داشته باشد.