

اطلاعات طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی با ریسک بالا

28 اکتبر 2024

نمای کلی طرح سرمایه‌گذاری

نام طرح سرمایه‌گذاری: طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی با ریسک بالا

تاریخ شروع: ۱ دی ۱۴۰۱

دارایی تحت مدیریت (AUM) اولیه: ۱۲۵.۱ میلیارد تومان

تعداد واحدها: ۱۲۵۱۰۰

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 با ریسک بالا، با سرمایه‌گذاری در سبدی متشکل از ۵ ارز دیجیتال بزرگ (۴۰٪) و ۱۵ کوین با ارزش بازار متوسط (۶۰٪) که بر اساس ارزش بازار وزن دهی شده‌اند، برای به حداکثر رساندن بازده استفاده می‌شود. پرتفوی به صورت ماهانه مجدداً بالانس می‌شود تا در عین همراهی با روندهای بهینه بازار، 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 ریسک بالا (گذشته‌نگر)

• بازده سالانه: ۴۰۳.۷۱٪

• میانگین بازده هفتگی: ۲.۵٪

معیارهای ریسک

• بتا^۱: ۱.۱۵

• نوسانات (انحراف معیار هفتگی): ۹.۶٪

• ارزش به ریسک^۲: ۹۵٪: ۸۴٪

^۱ معیاری برای سنجش نوسانات یک دارایی یا طرح سرمایه‌گذاری 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.

^۲ 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 شارپ³ : ۱.۵
- نسبت شارپ (بیتکوین): ۱.۰۴
- حداکثر افت⁴ (۶) (Max Drawdown ماه): -۳۸.۲%
- حداکثر افت (بیتکوین): -۴۰.۳%

ترکیب پورتنفوی

طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی با ریسک بالا از ۵ ارز دیجیتال با ارزش بازار بالا و ۱۵ ارز دیجیتال با ارزش بازار متوسط تشکیل شده، که وزن آنها متناسب با ارزش بازار است.

تخصیص دارایی‌های طرح سرمایه‌گذاری

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

۲۹.۱۴	Bitcoin	بیتکوین
۹.۵۲	Dogecoin	دوج کوین
۶.۷۴	TRON	ترون
۶.۵۵	Ethereum	اتریوم
۵.۹۳	Toncoin	تن کوین
۵.۴۹	Cardano	کاردانو
۴.۸۷	Avalanche	آوالانچ
۴.۷۱	Shiba Inu	شیبا اینو
۳.۲۶	Bitcoin Cash	بیتکوین کش
۳.۲۳	Chainlink	چینلینک
۲.۸۶	Polkadot	پولکادات

³ Sharpe Ratio: این شاخص نشان می‌دهد که یک طرح سرمایه‌گذاری به ازای ریسک‌های اضافی‌ای که سرمایه‌گذار متحمل شده، چه میزان بازده اضافی تولید کرده است.

⁴ این شاخص بیشترین کاهش درصدی ارزش یک پورتنفوی یا دارایی، از اوج ارزش خود تا پایین‌ترین نقطه را در یک دوره زمانی مشخص نشان می‌دهد.

۲.۴۴	Litecoin	لایت کوین
۲.۴۳	NEAR Protocol	نیر پروتکل
۲.۳۵	Sui	سویی
۲.۲۳	Aptos	آپتوس
۲.۱۴	Uniswap	یونی سواپ
۱.۸۷	BNB	بایننس کوین
۱.۸	Solana	سولانا
۱.۸	Pepe	پپه
۰.۶۴	XRP	ریپل

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 ماهانه 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، 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 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، 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.