

## اطلاعات طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی کم‌ریسک

28 اکتبر 2024

### نمای کلی طرح سرمایه‌گذاری

نام طرح سرمایه‌گذاری: طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی کم‌ریسک

تاریخ شروع: ۱ دی ۱۴۰۱

دارایی تحت مدیریت (AUM) اولیه: ۲۰۸.۵ میلیارد تومان

تعداد واحدها: ۲۰۸۵۰۰

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 کم‌ریسک، با سرمایه‌گذاری ۷۰ درصد از پرتفوی در استیبل‌کوین‌ها، ۱۵ درصد در ارزهای دیجیتال با ارزش بازار بالا و ۱۵ درصد در ارزهای دیجیتال با ارزش بازار متوسط، برای به حداقل رساندن ریسک و در عین حال بازدهی پایدار استفاده می‌شود. برای حفظ تعادل بین ریسک و بازده، 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 سرمایه‌گذاری در حال حاضر فعال نیست.

طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی کم‌ریسک (گذشته‌نگر)

- بازده سالانه: ۰.۶٪
- میانگین بازده هفتگی: ۰.۶٪

### معیارهای ریسک

- بتا<sup>۱</sup>: ۰.۵۷
- نوسانات (انحراف معیار هفتگی): ۲.۸٪

<sup>۱</sup> 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.

- ارزش به ریسک  $^2$  ۹۵٪ : ۳.۲٪
- نسبت شارپ  $^3$  : ۱.۳۶
- حداکثر افت  $^4$  (۶) (Max Drawdown ماه): -۱۲.۱٪

### ترکیب پورتفوی

طرح سرمایه‌گذاری کریپتویی کم‌ریسک از ۷۰ درصد استیبل‌کوین، ۱۵ درصد ارزهای دیجیتال با ارزش بازار بالا و ۱۵ درصد ارزهای دیجیتال با ارزش بازار متوسط تشکیل شده است. برای کاهش ریسک و تضمین بازدهی پایدار، پرتفوی ماهانه مجدداً بالانس می‌شود.

### تخصیص دارایی‌های طرح سرمایه‌گذاری

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

Tether USDt	۵۲.۵۱	Tether USDt
USDC	۱۵.۱۵	USDC
Bitcoin	۱۰.۹۳	Bitcoin
Ethereum	۲.۴۵	Ethereum
Dogecoin	۲.۳۸	Dogecoin
Dai	۲.۳۴	Dai
TRON	۱.۶۹	TRON
Toncoin	۱.۴۸	Toncoin
Cardano	۱.۳۷	Cardano
Avalanche	۱.۲۲	Avalanche

$^2$  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.

$^3$  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 پورتفوی یا دارایی، از اوج ارزش خود تا پایین‌ترین نقطه را در یک دوره زمانی مشخص نشان می‌دهد.

Shiba Inu	۱.۱۸	Shiba Inu
Bitcoin Cash	۰.۸۱	Bitcoin Cash
Chainlink	۰.۸۱	Chainlink
Polkadot	۰.۷۲	Polkadot
BNB	۰.۷	BNB
Solana	۰.۶۷	Solana
Litecoin	۰.۶۱	Litecoin
NEAR Protocol	۰.۶۱	NEAR Protocol
Sui	۰.۵۹	Sui
Aptos	۰.۵۶	Aptos
Uniswap	۰.۵۳	Uniswap
Pepe	۰.۴۵	Pepe

### 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 مدل‌های کمی پیشرفته را برای مدیریت سبد به کار می‌برد. همچنین به طور ماهانه پورترفوی را مجدداً متعادل می‌کند تا در فرصت‌های رشد بازار، سرمایه‌گذاری کند و در عین حال ریسک را به حداقل برساند. با استفاده از تحلیل کمی و تکنیکال، به شما اطمینان می‌دهیم که تمامی تصمیمات سرمایه‌گذاری، آگاهانه و مبتنی بر داده‌ها اتخاذ شده، که بر بهینه‌سازی بازده بر اساس پارامترهای ریسک این طرح سرمایه‌گذاری، 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 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.