

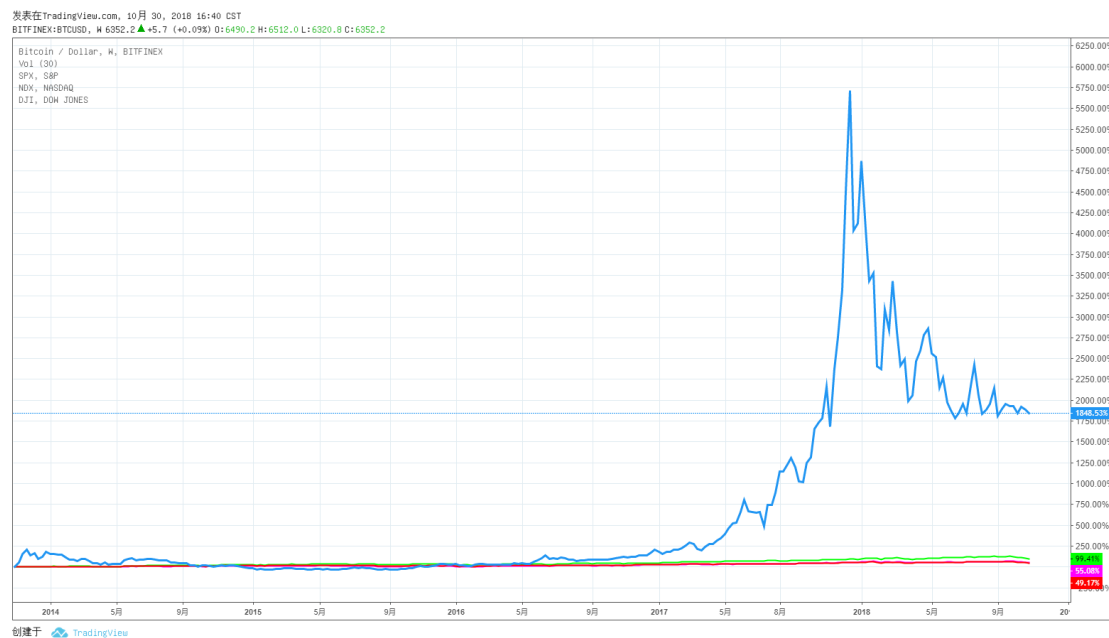
AKA Crypto Assets No.3 Fund USDT

AKA Crypto Assets No.3 Fund USDT

為何要投資數字資產？

自從 2008 年 BTC 誕生至今，加密數字資產的總市值已經超過 3000 億美元，隨著區塊鏈技術被越來越多的人認識並接受，我們認為下一個 10 年中，各類加密數字資產的價格也會水漲船高。對比傳統的投資標的，加密數字資產將會做為金融革命的先鋒，為投資者帶來更大幅度的回報。

BTC 與標普 500、納斯達克指數、道瓊斯指數過去 5 年的增長曲線圖



從圖中我們可以看到，BTC 最高時達到了 5711% 的增長，而同期的傳統投資方式相比之下明顯欠缺活力。因此我們可以據此認為，區塊鏈技術帶來的新投資時代已經到來！

為何要投資本基金

本基金由具備專業能力與優秀歷史業績的專業區塊鏈金融人士發起，至今受託管理著超過 5 萬個 BTC 的龐大資產。本基金採用系統化主動投資量化策略，以嚴謹的系統化方式分析投資基本面，從而取得穩定且出色的業績。在資訊氾濫的時代，具備以系統化的量化技術處理海量資料的能力是我們相當重要的優勢。同樣，當市場隨著日益增加的交易量及高效交易的需求處於不斷變化之時，能夠預測和解读市場形勢尤為重

要。我們早在 2015 年已將系統化主動投資策略的應用在數位資產前沿。目前我們在數字資產方面的投資已覆蓋全球的主要數字貨幣交易所和各個領域的區塊鏈項目，這意味著投資人可以按需選擇特定的主動型敞口：從主流數位資產到新興數位資產都可精確鎖定。我們也提供一系列市場中性策略，為投資者帶來與市場走勢不相關的總回報。

創新導向的投資方法



自最初開始管理側重價值型數位資產的投資組合以來，我們一直認為必需定期審視和改進我們的風險管理方法和投資流程，從而保持我們在這方面的優勢。我們致力於持續創新，目前正借助大資料的力量，尋找應對舊問題的新方案，並且嘗試以創新形式應用現有觀點，在各個市場環境中為客戶爭取持續的超額收益。



融入人的元素我們經驗豐富的投資專才具備學術、資料科學與金融和經濟方面的廣泛背景。無論是研究超額收益新構想，確保投資模型得到調整以符合當前市場環境，或是對模型研究結果提出質疑，團隊成員在投資過程中發揮了不可或缺的作用。憑藉多名資深投資人、研究員和策略師的共同努力，我們建立起健全的投資流程。

多種產品滿足客戶需要



我們提供廣泛的系統化主動投資策略服務，旨在為客戶帶來具有差異性的超額收益。這些服務包括側重超額收益並根據我們的研究觀點而設計的長倉和長倉/短倉策略，以及通過投資與傳統資產類別相關性較低的資產來說明客戶分散風險獲取回報的市場中性策略。

絕對收益

大容量策略群

程式化自動交易

業績期內對幣本位收益最高達近 7 倍，無論市場漲跌都可以獲利	策略組合包含多個獨立模型群，自動適應資產規模	先進的量化交易系統，排除交易情緒干擾，廣泛連接 16 家主流交易所深度
--------------------------------	------------------------	-------------------------------------

在資訊爆炸的時代，團隊結合最新科技與研究能力開發量化模型，加上 5 年駕馭龐大資訊流的經驗，替投資者掌握最新、最快、最高頻的市場趨勢。

投資目標

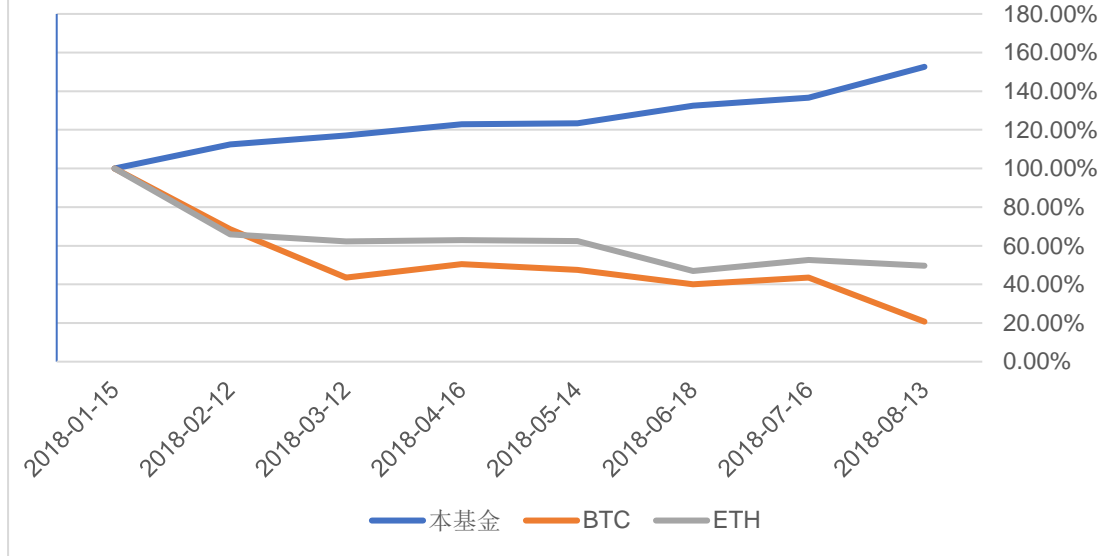
本基金主要使用主動性量化交易策略在二級市場投資於 BTC、ETH 等主流數字貨幣，同樣包括各類新興數位資產組合。本基金對各類投資標的的選擇和策略會適時改變，以達到淨值增長的目的。

投資策略

通過組合模型技術(Model of Models)在數位貨幣的現貨與期貨市場上，分別構建子模型形成多個獨立的回報流(量化、趨勢、概率、套利，消息驅動等)，再用一個更高層次的模型，對各個子模型進行風險計算與資產分配，對各個回報流進行合併處理，使 Mega Alpha 量化對沖基金這部投資機器能夠獲取源源不斷的阿爾法收益。

表現回顧

2018年1-8月增长曲线对比



收益率	最近 1 個月	最近 3 個月	最近 6 個月	成立以來
本基金	7.22%	17.45%	28.49%	50.43%
BTC	-4.79%	-27.75%	-29.45%	-54.42%
ETH	-39.73%	-60.78%	-67.02%	-77.82%

風險收益特徵

指標	本基金	BTC	ETH
標準差	14.49%	15.66%	18.87%
最大回撤	9.8%	60.57%	79.48%

本文所載的表現資料，基金表現僅作參考之用。投資涉及風險。過往業績並不代表將來的表現，基金價格及其收益可升可跌，並不能保證。投資價值亦可能受到匯率影響。本基金資料上的任何資訊不構成招攬任何人直接投資 AKA 管理的各個基金的要約邀請。AKA 管理的各個基金的發行人及經理人對發行管道的財富管理產品投資專案的合法性和適當性不負責任，且對發行管道的財富管理產品投資專案的投資者所作的投資決策不負責任。基金賺取收入的投資策略或會減低基金資本增長潛力以及將來的收入。基金投資於數位資產交易，較大的資產價格波動可招致重大虧損。基金賺取收入的投資策略或會減低基金資本增長的潛力以及將來的收入。本檔資料並不構成招攬任何人對本檔所述之投資項目做出投資。本檔、其中包含的任何資訊或基金權益尚未，且將不會，向中國的任何有關政府機關進行提交或登記，或經任何中國政府機關批准或核准，因此，其不得向中國的公眾提供或用於與任何在中國銷售基金權益的要約有關的行為。基金權益只能由有權投資於此類基金的投資人投資。投資人負責自行從有關政府機關(包括但不限於：國家外匯管理局、中國證券監督管理委員會、中國銀行業監督管理委員會以及其他相關監管主體)處獲得所有相關的政府審批、核准、許可或登記(如有)，且遵守所有適用的中國法規，包括但不限於任何相關外匯管理規定和/或境外投資規定。©2018 AKA Fintech Inc. 版權所有。