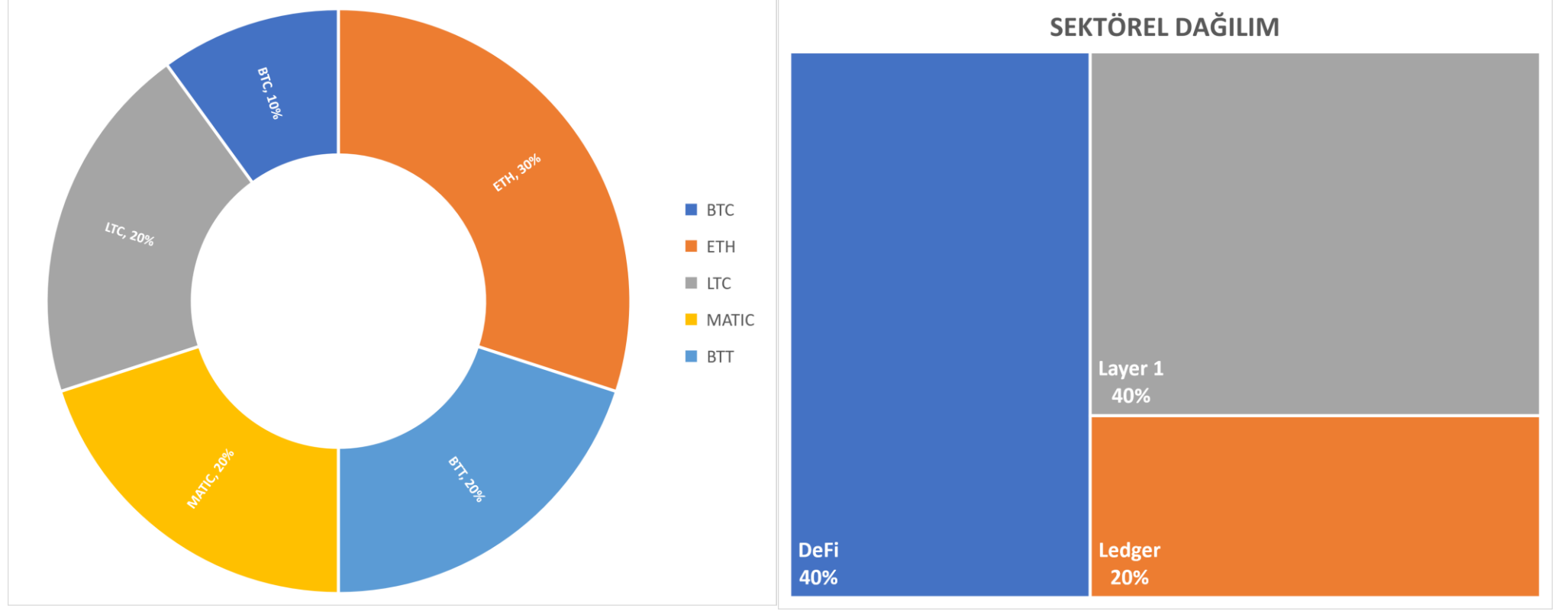


Model Portföy Detayları: 14.11.2022-21.11.2022



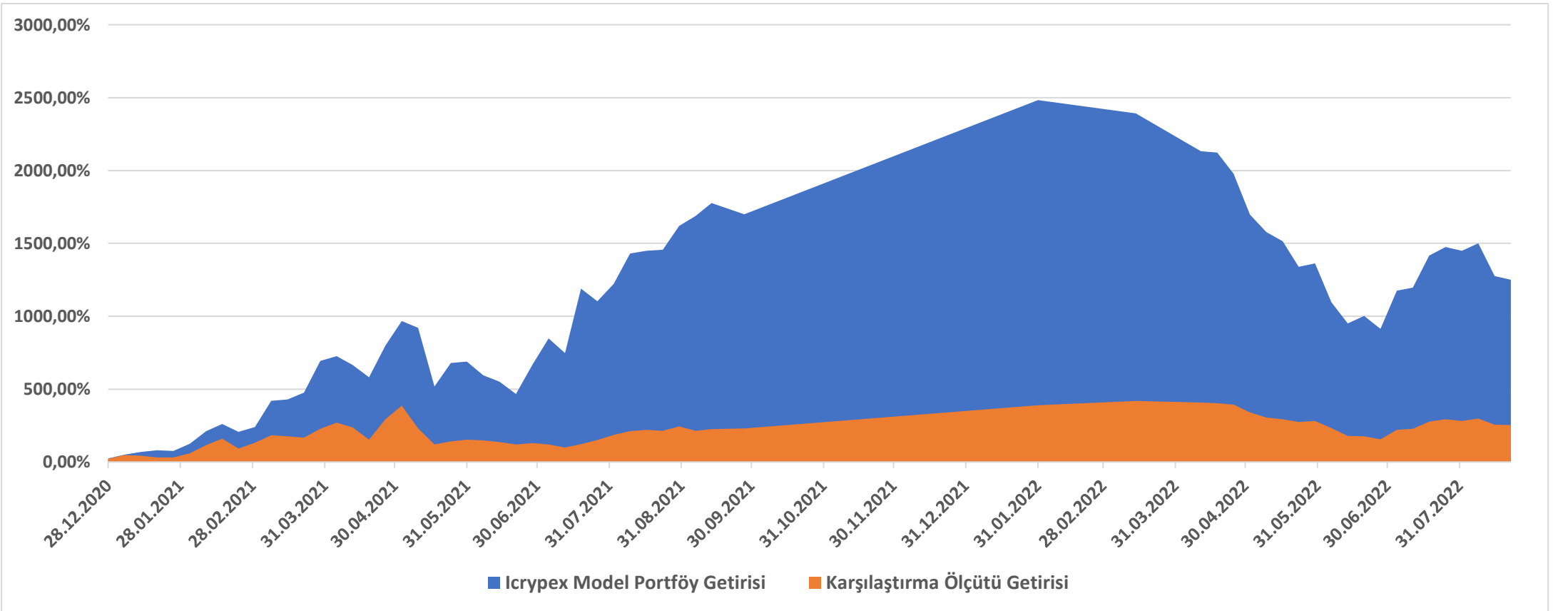
* Aşağıdaki getiri performansı 1 hafta öncesinin getilerini yansıtmaktadır. Portföy dağılım tablosu ise belirtilen tarihlerdeki dağılımı yansıtmaktadır. Model Portföy dağılım tablosu için müşteri temsilciniz ile iletişime geçiniz.

Getiri Performansı	1 Hafta	1 Ay	Yılbaşından Bugüne	2021	Kuruluştan Bugüne
Model Portföy Getirisi	-18,09%	-22,03%	-87,53%	399,27%	952,58%
Karşılaştırma Ölçütü Getirisi	-21,33%	-13,82%	-48,65%	204,61%	168,94%
Model Portföy Relatif Getirisi	3,24%	-8,21%	-38,88%	194,66%	783,65%

Sunulan veriler geçmiş dönemi yansıtmaktadır ve bilgilendirme amacıyla sunulmaktadır. Model Portföyün geçmiş performansı gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz. Rapor kapsamındaki açıklama ve getiri karşılaştırmaları reklam ve ilan niteliği taşımamaktadır ve performans ölçüm özelliğinde değildir.

Getiri Grafikleri

KURULUŞTAN BUGÜNE



ICRYPEX MODEL PORTFÖY

Model Portföyün Özellikleri

Model portföyde yatırımcının işleme başlayacağı tutar, yatırılan TL miktarının o gün ki Tether açılış fiyatının baz alınarak, tethere çevrilmesi ile elde edilen tether bakiyesidir.

Model portföyle yer alan varlıklar benzer kullanım amaçlarına göre Defi, DEX, Gaming, Ledger, MEME, Metaverse, NFT, Oracle, Layer 1, WEB3 ve diğerleri olarak kategorize edilen gruplar içinde sınırlandırılmıştır.

Model portföyün karşılaştırma ölçütünü hesaplanırken Icrypex Borsasında işlem gören coinlerin her birinin toplam piyasa değerleri, küresel piyasanın toplam piyasa değerine bölünerek bir oran elde edilmiştir. Icrypex Borsasında işlem görmeyen ürünlerin ağırlıklandırmaya dahil olmaması neticesinde toplam ağırlık 100%'ün altında çıktığından, elde edilen oranlar %100'e normalize edilmiştir.

Model portföyde, yatırımcının portföy tutarının tümü modelden elde edilen ağırlıklar göz önünde bulundurularak dağıtılmış olup, nakitte ya da tetherde para tutulmamaktadır.

Portföyün Standart Sapmasının Hesaplanması

Portföy yönetiminde risk "standart sapma" ile ölçülmektedir. Standart sapma bir varlığın geçmişteki fiyat verilerinin o varlıktan beklenen getiriden ne kadar uzaklaştığını göstermektedir. Modelde standart sapma;

$\sigma_p = \sqrt{w_1^2 \sigma_1^2 + w_2^2 \sigma_2^2 + 2w_1 w_2 Cov_{1,2}}$ formülü ile hesaplanmıştır.

σ : Varlıkların varyansını,

w: Varlıkların portföy içindeki ağırlığını,

Cov: Varlıkların kovaryansını ifade etmektedir.

Portföyün Ağırlıklandırılması

Riskli portföyler için optimum ağırlıklandırma, sharpe rasyosunun maksimize edilmesi ile elde edilir. Sharpe Rasyosu, portföyün ortalama getirisi ile risksiz getiri oranı arasındaki farkın, mutlak portföy riskine bölünmesi ile elde edilir. Portföyün toplam riski, standart sapma ile ölçülür.

Model portföy ağırlıklandırılırken, öncelikle sharpe rasyosu maksimize edilmiş olup, ardından bazı kısıtlar uygulanmıştır. Bu kısıtlar;

BTC/USDT \geq 0,10

ETH/USDT \geq 0,30

Piyasa değeri BTC/USDT ve ETH/USDT'ye kıyasla daha düşük olan altcoinlerin ağırlıklandırılmasında her biri için maksimum ağırlık oranı 0,20 ve toplam ağırlıkları 0,60'ı geçmeyecek şekilde sınırlandırılmıştır.

ICRYPEX
CRYPTO EXCHANGE
0850 255 1079

Tüm Hakları Saklıdır © 2018-2021 Icrypex Crypto Exchange
Icrypex Bilişim A.Ş. Maslak Mah. Maslak Meydan Sok. Spring Giz Plaza N:5/57 Sarıyer/İstanbul

E-Posta: info@icrypex.com

RİSK BİLDİRİMİ

Kripto varlıkların alımı, satımı ve saklanması belirli riskler taşımaktadır. Bu nedenle, Icrypex'te işlem yapmaya karar vermeden önce, aşağıda sayılanlarla sınırlı olmaksızın karşılaşılabileceğiniz olası her türlü riski iyi anlamanız, değerlendirmeniz ve söz konusu riskleri dikkate alarak karar vermeniz gerekmektedir. Dijital paralar yüksek risk ve oynaklık içeren hareketlilik gösterebilir. Icrypex Bilişim A.Ş.'nin, arz talep ilişkisine göre belirlenen kripto varlıkların fiyatlarının değişmesinden (Icrypex'te yapılan alım-satım işlemleri esnasında gerçekleşen fiyat değişiklikleri de dahil ancak bunlarla sınırlı olmamak kaydıyla) dolayı hiçbir sorumluluğu yoktur. Bu sebeplerle doğmuş ya da doğacak tüm zarar ve kayıpların sorumluluğu kullanıcılara aittir. Icrypex Bilişim A.Ş.'nin kişisel verilerinizi elde etme, saklama ve işleme faaliyetlerine ilişkin detay bilgilere [Kişisel Verilerin Korunması Kanunu Aydınlatma Metni](#)'nden ulaşabilirsiniz. [Gizlilik Sözleşmesi](#) ve [Kullanıcı Sözleşmesi](#) için tıklayınız.