



# Blockin Capital

Pitch Deck

**August 2024**  
Confidential

# 关于

# Blockin Capital

Blockin Capital致力于在创新与稳健之间找到平衡, 通过CeFi和DeFi量化策略, 为投资者提供长期稳定的收益。

Blockin Capital是一家专业的加密货币量化交易公司, 成立于2021年DeFi Summer期间。公司专注于加密货币二级市场的量化交易。我们的核心团队成员曾在全球知名投资机构工作, 具备国际视野和丰富的投资经验。

我们的策略包括流动性挖矿、自动化做市和高频套利等, 主要以Delta中性稳健策略为主, 能够在牛市和熊市中都为投资者创造稳定收益。

目前, 我们管理的资产规模约为一亿美元, 并获得了Antalpa、Matrixport和Time Research等知名机构的投资支持。

## Blockin Capital 概况

|         |              |
|---------|--------------|
| 总资产管理规模 | \$100M       |
| 平均年利率   | 18%-25%      |
| 夏普指数    | 5.5-8(因策略而异) |
| 成立日期    | 2021年        |
| 位置      | 香港           |

# 核心能力

## + 稳定的历史业绩

在牛市、熊市和黑天鹅事件中  
表现稳定, 年化收益率  
18%-25%。

## + 顶尖的技术团队

团队成员均来自世界名校, 平均拥有5年以上加密行业经验, 自公司成立以来保持稳定。

## + 顶级合作伙伴

与交易所和机构客户有紧密联系, 建立了强大的合作网络。

# 核心团队

## Ryan REN

管理合伙人

拥有15年金融从业和创业经验，在美国Capital One负责零售金融产品的信贷策略；2016年回国创业，任PINTEC集团合伙人，2018年公司成功上市NASDAQ。2018年进入加密行业，第一批DeFi矿工，参与孵化了币圈多个早期项目。

## Charles WANG

量化投资总监

- 拥有6年DeFi加密投资及交易经验
- 曾管理资产规模超6000万美金
- 擅长资产筛选，策略制定，以及对链上资产的风险控制
- 在UST、三箭资本及FTX事件中敏锐察觉风险，规避了黑天鹅事件带来的重大损失
- 毕业于伦敦国王学院



## Steven ZHANG

CeFi策略总监

- 拥有超过5年的加密货币行业经验
- 在传统券商机构担任高级量化分析师5年
- 开发了多个成功的加密货币量化交易策略，特别是在资费套利和流动性监控系统方面表现突出
- 拥有深厚的市场分析和风险管理专业知识



香港中文大学  
The Chinese University of Hong Kong

## Kevin DU

技术总监

- 拥有10年开发经验和5年的区块链智能合约开发经验
- 在Hashkey Group带领技术团队，包括同态加密，MPC，零知识证明等
- 主导了safeWallet合约开发，私钥托管服务开发等项目
- 带领团队开发多个DeFi策略，包括链上套利，RFQ策略等



## Amy QI

投资者关系

- 拥有5年传统及加密投资经验
- 曾管理资产规模超过3000万美元，包括多种类型的投资组合，从传统一级市场项目到加密基金
- 擅长基金运营及LP关系维护
- 毕业于马塞诸塞州立大学和香港浸会大学



# 我们可提供的 产品与服务



## 加密量化基金

我们有多种量化交易策略  
包括, 流动性挖矿、自动  
化做市和高频套利, 根据  
投资人不同币种和风险承  
受能力的需求提供不同产  
品



## 代币做市

自2021年以来, 我们在做  
市业务领域积累了丰富的  
经验, 目前主要在  
Binance和OKX等主要交  
易所提供流动性。



## 场外交易 (OTC)

专注于为高净值客户和机  
构投资者提供流动性和灵  
活性, 确保交易的高效执  
行, 为客户实现大额资产  
的无缝转移和交易。

# 策略一：

## CeDeFi 中性策略 (USDT本位)

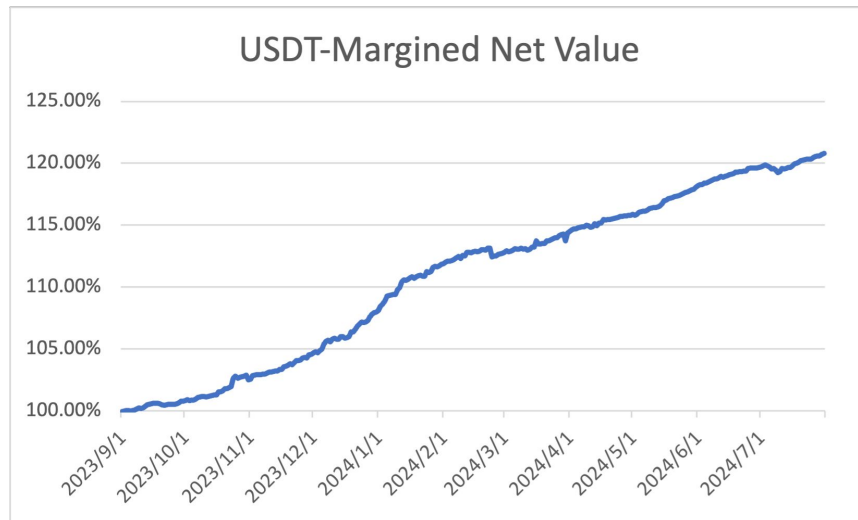
USDT本位, 回撤率极低, 平均收益高于 CeFi套利策略。

### 策略概述：

链上去中性化交易所 (DEXs) 做市+动态对冲, 提供稳定可靠的中性市场回报。Blockin结合链上+链下数据, 通过自研算法, 动态调整对冲逻辑和策略暴露的总头寸, 致力在提供稳健收益的同时, 减少对冲的磨损, 提高对冲效率。

### 策略特点：

- 结合DeFi+CeFi的优势, 选择协议, 灵活配置资金;
- 严管控: 自动化风控预警, 限制敞口头寸;
- 高收益: 策略平均收益高于纯中性化套利策略。



\*产品实盘表现

|        |                                |
|--------|--------------------------------|
| 实盘起止日期 | 2023/9/1-2024/7/31             |
| 总体回报率  | 20.80%                         |
| 年化收益率  | 22.66%                         |
| 总最大回撤: | 0.61%                          |
| 交易场所:  | Perp DEXs (i.e. GMX, MUX etc.) |

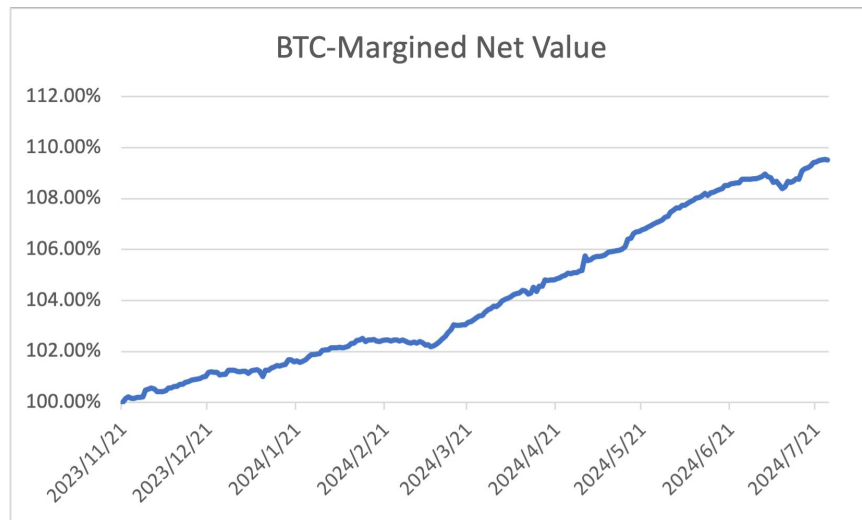
\*本报告数据仅代表历史业绩, 不构成未来业绩的保证。

## CeDeFi 中性策略 (BTC本位)

BTC本位, 回撤率极低, 平均收益高于 CeFi套利策略。

### 策略特点:

- 优配置: 资金比例优化配置, 显著提高资金利用效率
- 降风险: 多元化设置风控预警 有一键停机机制
- 宽部署: 根据市场情况及矿池特点 优选最佳矿池, 保证稳定收益



\*产品实盘表现

|        |                                |
|--------|--------------------------------|
| 实盘起止日期 | 2023/11/21-2024/7/25           |
| 总体回报率  | 9.93%                          |
| 年化收益率  | 14.26%                         |
| 总最大回撤: | 0.57%                          |
| 交易场所:  | Perp DEXs (i.e. GMX, MUX etc.) |

\*本报告数据仅代表历史业绩, 不构成未来业绩的保证。

## 策略二： CeFi 资金费率套利策略

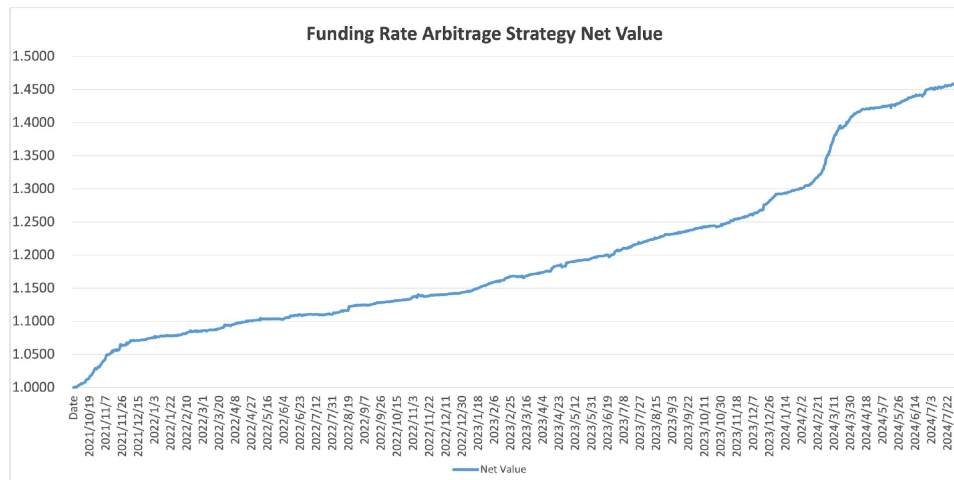
USDT本位, 围绕Delta Neutral, 稳定策略为主

自2021年10月成立以来, 该策略平均年化收益率16.2%, 累计收益率45.88%, 最大回撤仅0.33%。这一表现凸显了策略在市场低迷或下跌时的稳健性。

### 策略概述：

我们的算法交易策略通过自动化捕捉资金费率和基差之间的套利机会, 提供稳定且低回撤的收益。

|        |              |
|--------|--------------|
| 累计回报：  | 45.88%       |
| 年化收益率： | 16.20%       |
| 夏普比率：  | 8.39         |
| 总最大回撤： | 0.33%        |
| 交易场所：  | Binance, OKX |



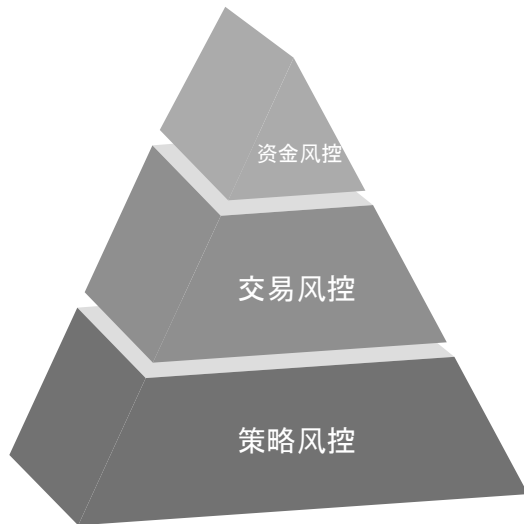


# 严格的 风控系统

## 24小时监控市场

为您的资金安全保驾护航

Blockin拥有严格的风控系统, 24小时监控市场、设定最大敞口比例、采用行业领先的安全标准, 并通过量化模型和对冲策略控制风险。先进的数据加密和访问控制确保交易数据安全, 智能监控系统实时应对市场波动, 全面保障您的投资安全。



综合采用Gnosis、Cobo等行业标准方法保证资金安全

确保交易规范性和透明性, 采用严格的操作流程和多层次审核机制, 并最小化操作风险。

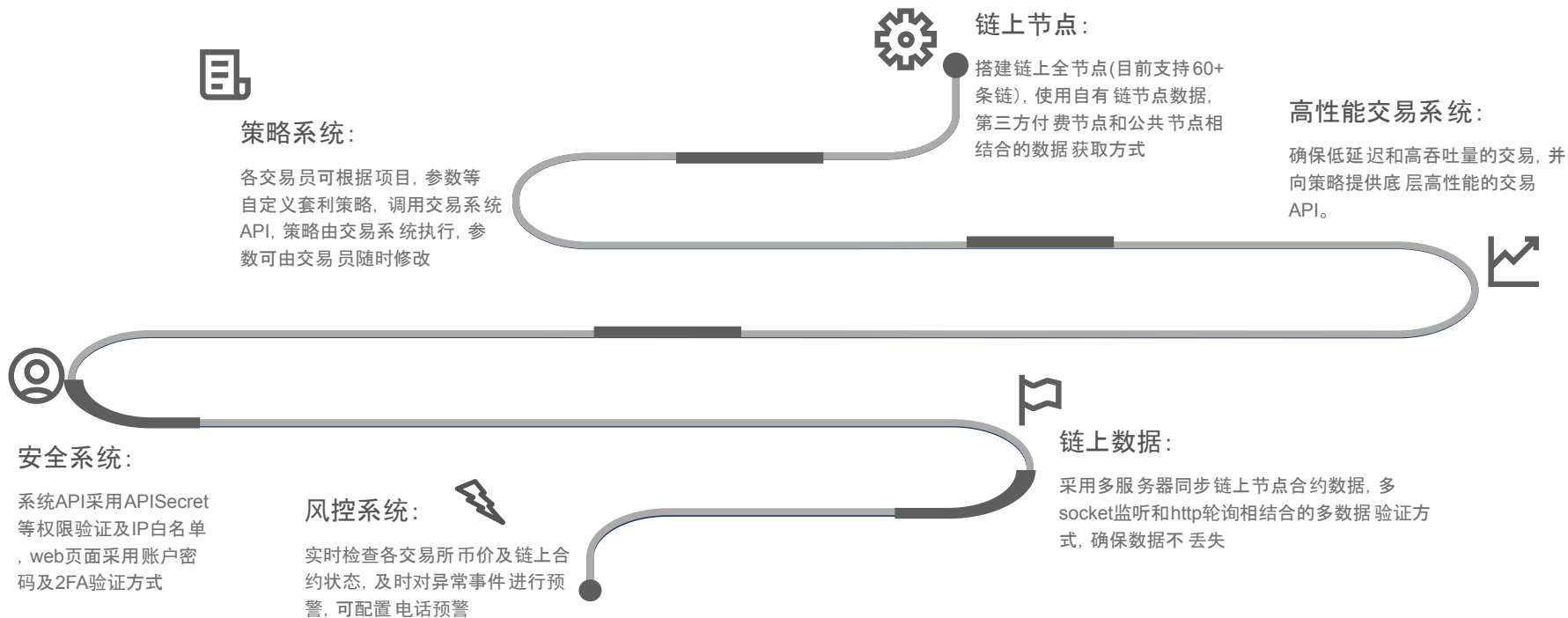
## 自动化监控 & 各时区交易员24h值班轮岗盯盘

实时监控交易系统核心数据, 严格控制权限, 确保交易所账户等敏感信息的安全性。系统CPU、内存、磁盘使用率、网络IO等指标全天候监控。

## 严谨稳健的头寸管理体系

利用先进的量化模型和动态市场分析, 实时识别和评估市场波动和潜在风险因子; 设定严格的风险敞口

# 技术栈和基础设施



# 合作模式

## 合作模式一：设立专户托管

### 投资CeFi策略：

- 投资人在中心化交易所存入资金。
- 投资人提供给Blockin团队API密钥(只有操作权限)
- Blockin执行套利策略。

### 投资DeFi策略：

- Blockin与投资人共建一个多签钱包，通常使用Gnosis Safe或Cobo。
- 只有在Blockin和投资人共同签名钱包时，资金才能划转到去中心化交易所。

## 合作模式二：投资基金(已启动)

Blockin Capital 将与 Pando Finance 共同设立SPC基金(使用Pando香港4号牌开展业务)

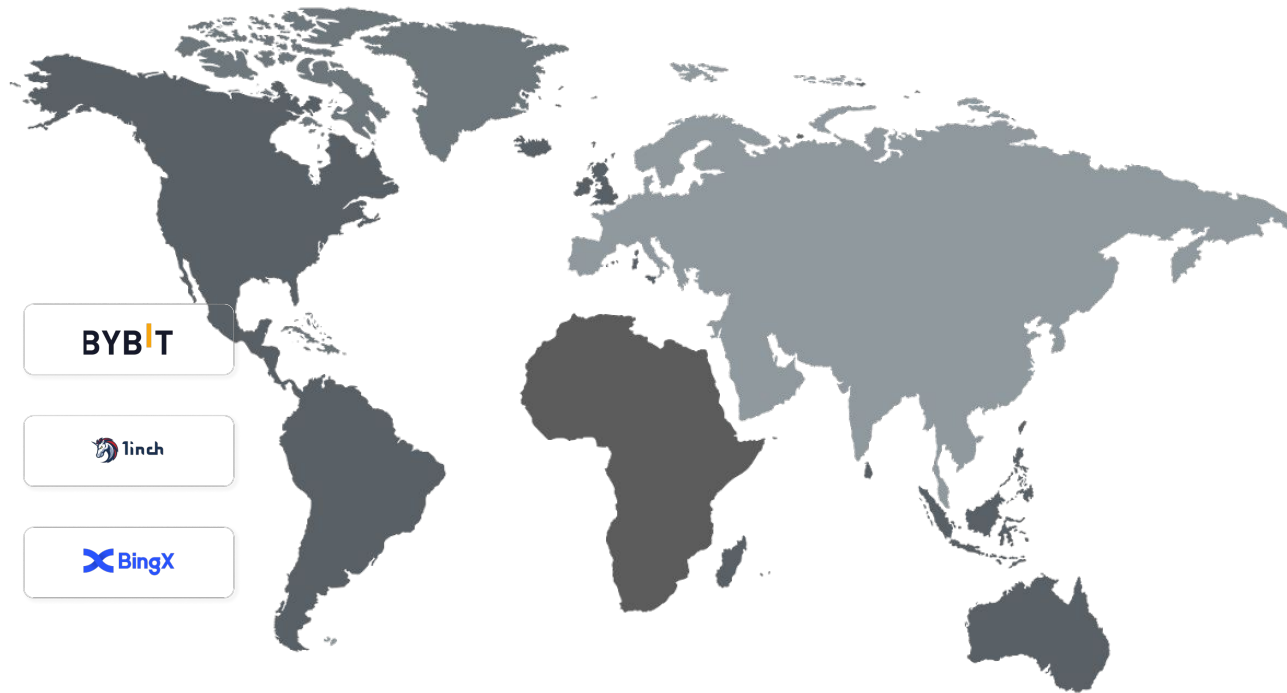
Blockin Capital 将与 Liquidity TechProtocol (LTP) 共同设立专项基金

## 要素表

---

|                  |                                 |
|------------------|---------------------------------|
| 产品类型             | 开放式产品                           |
| Exchange交易所      | Binance, OKX, GMX, MUX, Uniswap |
| 支持币种             | USDC, USDT, BTC, ETH            |
| Trading strategy | 流动性挖矿、自动化做市和高频套利                |
| 锁定期              | 三个月                             |
| 申购赎回             | 随时申购, 按月度赎回                     |
| 最低认购额            | \$100万美元                        |
| 分配机制             | 月度                              |
| Report           | 月报                              |

## 我们服务的 机构客户



  
BINANCE



BYBIT

 solv

 GMX

 1inch

 ANTALPHA

 matrixport

 BingX

 UNISWAP



# Blockin Capital

致力于在创新与稳健之间找到平衡，为投资者提供长期稳定的收益。

联系我们: [admin@blockin.org](mailto:admin@blockin.org)