

Inspira Crea Transforma

ESTAFAS EN CRIPTOMONEDAS

Presentado por:
Mateo Restrepo S.
Juan S. Cárdenas R.
David Plazas E.

Profesor: José D. Morcillo B.

Modelación y Simulación III
Ingeniería Matemática
Departamento de Ciencias Matemáticas
Escuela de Ciencias
Universidad EAFIT
2018

1. PLANTEAMIENTO DEL PROBLEMA

2. DIAGRAMA FLUJOS Y NIVELES

2.1 Diagrama Causal

2.2 Diagrama Flujos y Niveles

3. RESULTADOS

3.1 Prueba de Consistencia Dimensional

3.2 Prueba de Escenario Base

3.3 Prueba de Condiciones Extremas

4. POLÍTICAS

4.1 Implementación de Impuestos

4.2 Regulación de Inversionistas

5. CONCLUSIONES

REFERENCIAS BIBLIOGRÁFICAS

PLANTEAMIENTO DEL PROBLEMA

1. PLANTEAMIENTO DEL PROBLEMA

"It's not that Bitcoin is a scam – the technology behind bitcoin, blockchain, isn't a scam, but the way it is trading is a scam" Jordan Belfort^I

- ▶ Bitconnect: 96 % caída del precio a principios del 2018.
- ▶ Mt.Gox Bitcoin Currency Exchange 600000 BTC valorado en 188 millones USD.
- ▶ ETH Connect, Bunny Token, NEO Connect y XRConnect están haciendo la misma metodología.



Figura 1. Situación Bitcoin^{II}.

DIAGRAMA FLUJOS Y NIVELES

2. DIAGRAMA FLUJOS Y NIVELES

2.1 Diagrama Causal

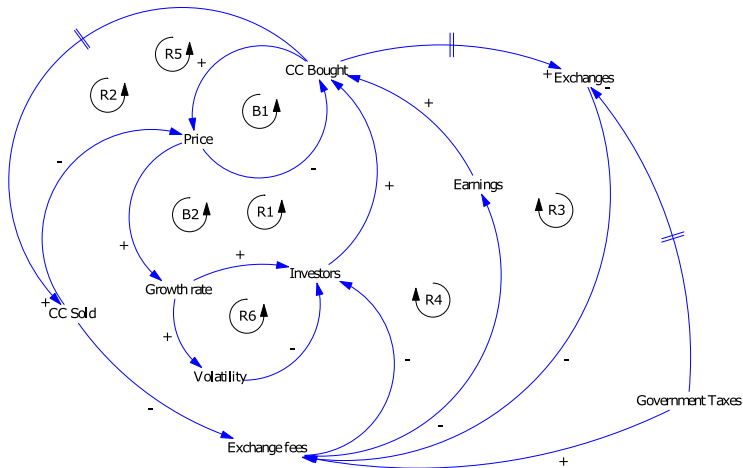


Figura 2. Hipótesis dinámica para el modelo.

2. DIAGRAMA FLUJOS Y NIVELES

2.2 Diagrama Flujos y Niveles

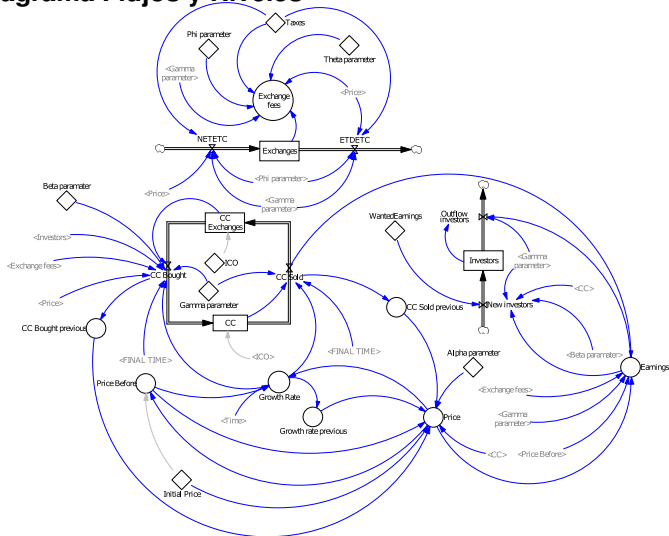


Figura 1. Diagrama de Flujos y Niveles.

RESULTADOS

3. RESULTADOS

3.1 Prueba de Consistencia Dimensional

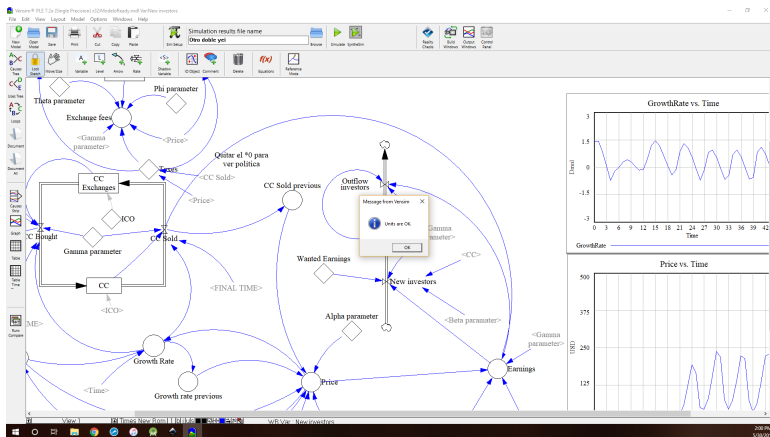


Figura 3. Prueba de consistencia dimensional.

3. RESULTADOS

3.2 Prueba de Escenario Base

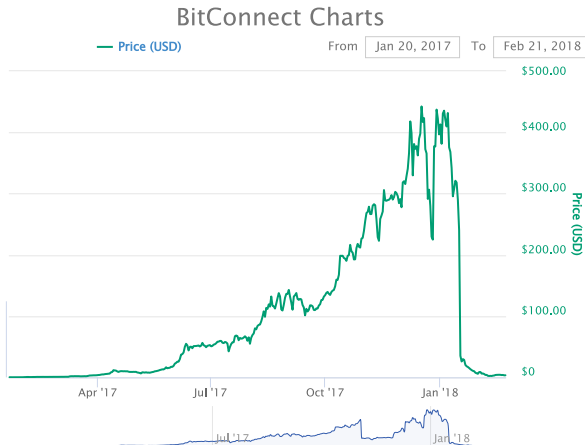
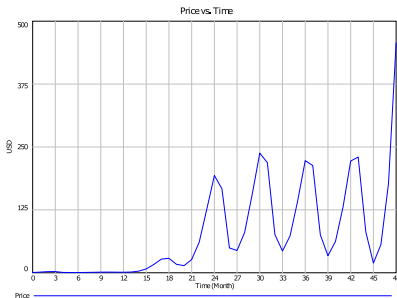


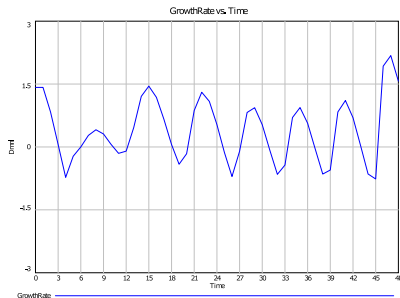
Figura 4. Precio BitConnect Coin

3. RESULTADOS

3.2 Prueba de Escenario Base



(a) Resultados para precio.

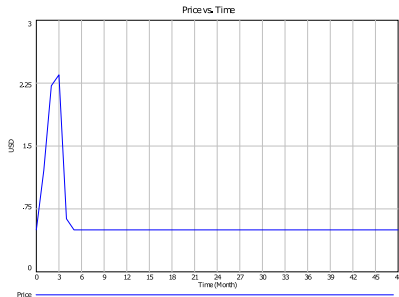


(b) Resultados para tasa de crecimiento.

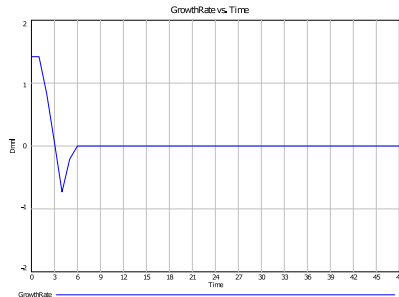
Figura 5. Prueba de escenario base para el modelo.

3. RESULTADOS

3.3 Prueba de Condiciones Extremas: CC Compradas



(a) Resultados para precio.

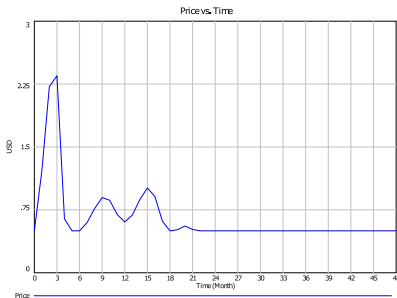


(b) Resultados para tasa de crecimiento.

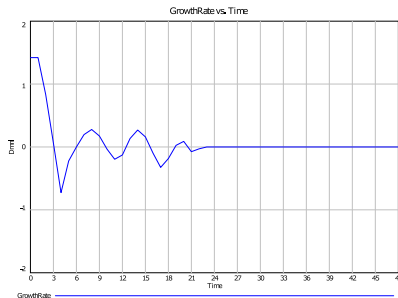
Figura 6. Prueba de condiciones extremas para CC compradas.

3. RESULTADOS

3.3 Prueba de Condiciones Extremas: Inversionistas



(a) Resultados para precio.



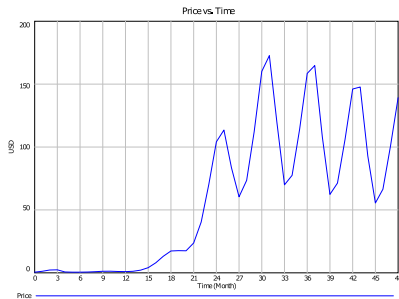
(b) Resultados para tasa de crecimiento.

Figura 7. Prueba de condiciones extremas para inversionistas.

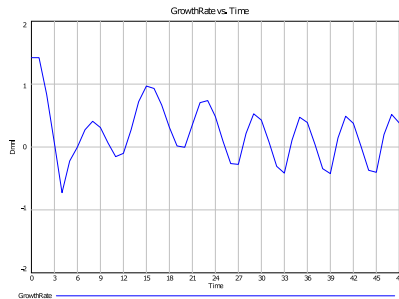
POLÍTICAS

4. POLÍTICAS

4.1 Implementación de Impuestos



(a) Resultados para precio.

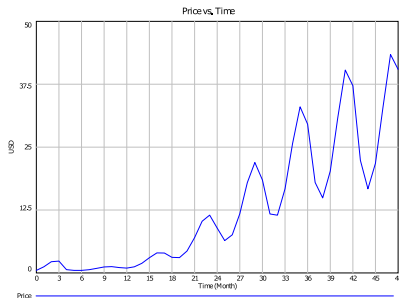


(b) Resultados para tasa de crecimiento.

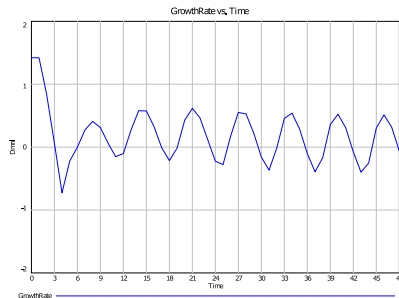
Figura 8. Resultados después de implementar impuestos.

4. POLÍTICAS

4.2 Regulación de Inversionistas



(a) Resultados para precio.



(b) Resultados para tasa de crecimiento.

Figura 9. Resultados después de regular la cantidad de inversionistas.

CONCLUSIONES

5. CONCLUSIONES

- ▶ Se logró construir un modelo funcional que represente gran parte del mercado de criptomonedas, validarlo y aplicar ciertas políticas para llegar a un estado deseado.
- ▶ Se lograron construir ecuaciones acorde a la dependencia directa o inversamente proporcional entre las variables del sistema; no obstante, se sugiere para trabajo futuro un estudio más detallado de estas ecuaciones y de algunos parámetros, debido a la sensibilidad del modelo ante algunos cambios en éstos.

BIBLIOGRAFÍA I

- ▶ FoxBusiness, "itcoin is a 'social experiment', says 'wolf of wall street' jordan belfort," 2017, <https://crypto-lines.com/wp-content/uploads/2018/02/rise-of-BTHtrends.jpg>, accessed on 2018-05-03.
- ▶ <https://crypto-lines.com/wp-content/uploads/2018/02/rise-of-BTHtrends.jpg>, accessed on 2018-05-03.
- ▶ MIX, "How bitconnect pulled the biggest exit scheme in cryptocurrency," 2018, [=https://thenextweb.com/hardfork/2018/01/17/bitconnect-bitcoin-scam-cryptocurrency/](https://thenextweb.com/hardfork/2018/01/17/bitconnect-bitcoin-scam-cryptocurrency/), accessed 2018-02-18.
- ▶ K. Amadeo, "Foreign exchange market: The market that dwarfs the stock market," 2018, <https://www.thebalance.com/foreign-exchange-market-3306088>, accessed 2018-02-18.
- ▶ "Initial coin offering (ico)," 2018, [url=https://www.investopedia.com/terms/i/initial-coin-offering-ico.asp](https://www.investopedia.com/terms/i/initial-coin-offering-ico.asp), accessed 2018-02-18.
- ▶ "Growth rates," 2018, <https://www.investopedia.com/terms/i/initial-coin-offering-ico.asp>, accessed 2018-03-9.
- ▶ I. Eyal, A. E. Gencer, E. G. Sirer, and R. van Renesse, "Bitcoin-ng: A scalable blockchain protocol," 2016, <https://www.usenix.org/system/files/conference/nsdi16/nsdi16-paper-eyal.pdf>, accessed 2018-02-19.

BIBLIOGRAFÍA II

- ▶ U. Government, "Investor alert: Ponzi schemes using virtual currencies," 2013, <https://www.investor.gov/additional-resources/news-alerts/alerts-bulletins/investor-alert-ponzi-schemes-using-virtual>, accessed 2018-02-19.
- ▶ Albrecht, Chad, Morales, Victor, Baldwin, J. Kristian, Scott, and S. Deron, "Ezubao: a chinese ponzi scheme with a twist," *Journal of Financial Crime*, vol. 24, no. 2, pp. 256–259, 2017.
- ▶ V. Gaucan, "Introduction to the foreign exchange markey," *Journal of Knowledge Management, Economics and Information Technology*, 2010.
- ▶ F. Tepper, "Bitconnect, which has been accused of running a ponzi scheme, shuts down," 2016, <https://techcrunch.com/2018/01/16/bitconnect-which-has-been-accused-of-running-a-ponzi-scheme-shuts-down/>, accessed 2018-02-19.
- ▶ N. Gandal, J. Hamrick, T. Moore, and T. Oberman, "Price manipulation in the bitcoin ecosystem," *Monetary Economics*, 2018.
- ▶ J. Adkisson, "Bitcoin, cryptocurrency and the government regulation paradox," 2018, <https://www.forbes.com/sites/jayadkisson/2018/01/29/bitcoin-cryptocurrency-and-the-government-regulation-paradox/#29686e073531>, accessed 2018-04-10.

Gracias