

量化基金：MAKER 一号

Jun '18

bilibilihuangyifan

This is a high frequency hedging strategy using Bellman Ford Moore's algorithm to detect negative cycle in the full graph of all offers.

Fund ID: 10

Fund raising period: 2018.06.24 - 2018.06.30

Price: 0 BTC + 0 ETH + 1 XRP

Hard top: 10000

Expected end date: 2018.07.30

Jun '18

bilibilihuangyifan

收益率计算：

本基金以XRP数量计算收益，比如：如果初始募集得到 10000 XRP，基金运行结束时总资产折合 11000 XRP，则“实际利润”为 $11000 - 10000 = 1000$ XRP，“实际收益率”为 $1000 / 10000 = 10\%$ ，如果基金运行30天结束，则“年化收益率”为 $(1 + 10\%)^{(365/30)} - 1 \approx 213.84\%$ ，“年化利润”为 $10000 * 213.8\% = 21384$ XRP

收益分配：

基金运行结束后将按申购时的份额同比例赎回，本金部分全部归属投资者，“实际利润”部分分配给投资者，基金策略提供者（基金经理）和 BlockHedging 网站。分配给投资者的利润比例是50%，分配给基金经理的利润比例是45%，分配给 BlockHedging 网站的利润比例是5%

举例：投资者A用100XRP申购100份额的基金，基金募集10000份满额共 10000 XRP 开始运行，基金运行结束后，若此时基金账户资金折合为 XRP 的数量 N

1. 小于或等于 10000

则所有剩余本金全部归属投资者，A将会得到 $N / 10000 * 100 = 0.01N$ XRP

2. 大于 10000

本金 10000 XRP 全部归属投资者, 利润 $(N-10000) * 0.5$ XRP 归属投资者, 归属投资者共计 $0.5 * (N+10000)$ XRP。A 将会得到 $0.5 * (N+10000) / 10000 * 100 = (0.005 * N + 50)$ XRP
基金经理得到 $(N-10000) * 0.45$ XRP
BlockHedging 网站得到 $(N-10000) * 0.05$ XRP

赎回规则:

当发生以下情况之一时赎回:

1. 基金到期
2. 基金经理要求提前结束基金运行
3. 基金运行过程中亏损达到 30%
4. BlockHedging 发现基金经理有违规操作将强制赎回, 违规操作包括但不限于: 不按时报告运行情况, 虚报收益, 资金违规挪用等

guhnhhaa

Jun '18

群主你这个比大奖章基金收的费还高啊, 看来群主是要秒杀西蒙斯啊。



来源：

<https://xueqiu.com/3309816647/65925061>

<https://baike.baidu.com/item/大奖章基金/3836659>

echo-ray

Jun '18

<https://xueqiu.com/3926587841/88299975>

不同的市场

任何基金费率的制定也没有强制要求别人接受

guhnhhaa

Jul '18

不说啥了，群主是，真·秒杀西蒙斯。

Jul '18

~~bilibilihuangyifan~~

MAKER 一号运行情况报告

截止2018年7月10日零点，基金已经运行10天，期间累计收益1233 XRP，“实际收益率”为12.33%，“年化收益率”为 $(1+12.33\%)^{(365/10)} - 1 = 6868\%$ ，其他指标：

Sharpe Ratio 30min: 0.2041436194

Sharpe Ratio daily: 1.2083511958

maxWithdrawal: 0.854538549183 %

withdrawalStart: Mon Jul 2 20:33:48 2018

withdrawalEnd: Mon Jul 2 22:33:48 2018

解释说明：

1. **Sharpe ratio** 依赖于数据取样精度，按最短精度30分钟计算：0.204；按天计算：1.208
2. 最大回撤：0.85%
3. 7月4号下午起到7月6号晚期间交易平台接口出现意外bug，已修复

总体来说这十天的运行情况符合预期，没有提前赎回的计划。

Tobemaker

Jul '18

太厉害了大佬，这个基金秒杀，在不考虑xrp下滑的情况下。不知道大佬以后会不会建立一个usdt对冲基金

biquanxiaosan

Jul '18

maxWithdrawal?是drawdown吗? 看着我还以为是投资人赎回了多少呢。大佬能先至少把名词搞清楚再来割韭菜吗

Jul '18

bilibilihuangyifan

不好意思, 下次报告改

Jul '18

bilibilihuangyifan

bilibilihuangyifan:

MAKER 一号运行情况报告

截止2018年7月10日零点, 基金已经运行10天, 期间累计收益1233 XRP, “实际收益率”为12.33%, “年化收益率”为 $(1+12.33\%)^{(365/10)} - 1 = 6868\%$, 其他指标:

Sharpe Ratio 30min: 0.2041436194

Sharpe Ratio daily: 1.2083511958

maxWithdrawal: 0.854538549183 %

withdrawalStart: Mon Jul 2 20:33:48 2018

withdrawalEnd: Mon Jul 2 22:33:48 2018

解释说明:

1. **Sharpe ratio** 依赖于数据取样精度, 按最短精度30分钟计算: 0.204; 按天计算: 1.208
2. 最大回撤: 0.85%
3. 7月4号下午起到7月6号晚期间交易平台接口出现意外bug, 已修复

总体来说这十天的运行情况符合预期, 没有提前赎回的计划。

MAKER 一号运行情况报告

截止2018年7月22日9点, 基金已经运行22天, 期间累计收益3092 XRP, “实际收益率”为30.92%, “年化收益率”为 $(1+30.92\%)^{(365/22)} - 1 = 8634\%$, 其他指标:

Sharpe Ratio 30min: 0.211045561321

Sharpe Ratio daily: 1.1782678288

maxDrawdown: 0.854538549183 %
maxDrawdownStart: Mon Jul 2 20:33:48 2018
maxDrawdownEnd: Mon Jul 2 22:33:48 2018

解释说明:

Sharpe ratio 依赖于数据取样精度, 按最短精度30分钟计算: 0.211; 按天计算: 1.178

最大回撤: 0.85%

运行情况符合预期, 没有提前赎回的计划。

monosai

Jul '18

下一期什么时候开始

Jul '18

bilibilihuangyifan

MAKER 一号运行情况报告

截止2018年7月30日11点, 基金已经运行31天, 期间累计收益 4925 XRP, “实际收益率”为 49.25%, “年化收益率”为 $(1+49.25\%)^{(365/31)} - 1 = 11061\%$, 其他指标:

Sharpe Ratio 30min: 0.20414591884

Sharpe Ratio daily: 1.28213709297

maxDrawdown: 0.854538549183 %

maxDrawdownStart: Mon Jul 2 20:33:48 2018

maxDrawdownEnd: Mon Jul 2 22:33:48 2018

解释说明:

由于网络通信故障, 资金数据有数次间断, 由此会对 Sharpe Ratio 的计算造成误差。

Sharpe ratio 依赖于数据取样精度, 按最短精度30分钟计算: 0.204; 按天计算: 1.282

最大回撤: 0.85%

MAKER 一号一期于今天正式到期, 分配给投资者的总利润是 2462.5 XRP 。一期的清算工作结束之后将会开启MAKER 一号二期的运行。

Jul '18

bilibilihuangyifan

MAKER 一号一期已经结算完成, 每份返还 1.246 XRP

Sep '18

bilibilihuangyifan**MAKER 一号二期运行情况报告**

截止2018年9月1日12点, 基金已经运行31天, 期间累计收益 8761 XRP, “实际收益率”为 58.4%, “年化收益率”为 $(1+58.4\%)^{(365/31)} - 1 = 22388\%$, 其他指标:

Sharpe Ratio 30min: 0.223799618977

Sharpe Ratio daily: 1.28068551209

maxDrawdown: 1.08751941999 %

maxDrawdownStart: Wed Aug 15 00:38:08 2018

maxDrawdownEnd: Wed Aug 15 10:38:08 2018

解释说明:

由于网络通信故障, 资金数据在8月25日至8月27日期间有丢失, 由此会对 Sharpe Ratio 的计算造成误差。

Sharpe ratio 依赖于数据取样精度, 按最短精度30分钟计算: 0.224; 按天计算: 1.280

最大回撤: 1.09%

MAKER 一号二期于今天正式到期, 分配给投资者的总利润是 4380 XRP 。二期的清算工作结束之后将会开启MAKER 一号三期的运行。

chanlun123

Sep '18

看了下群主的这个marker 1号, 好厉害, 在熊市的时候, 有这个收益率很不错了.
每个月开一次吗? 希望下个月可以参与进来.

**ethan**

Oct '18

楼主, 我看二期还有一些额度, 请问现在还可以加进去xrp吗?

BlackTrace

Oct '18

三期还有额度, 还能进吗?

bilibilihuangyifan

2019.02.11 MAKER 一号三期提前赎回,
赎回是基金账户账户余额: 78545 XRP, 归属投资者: 63309 XRP, 归属基金经理: 13712.4 XRP, 归属网站FPS持有者: 1523.6 XRP