

# KLUCZOWE INFORMACJE DLA INWESTORÓW



## Inwestowanie ze sztuczną inteligencją

Zarządzanie funduszem algorytmicznym wymaga dyscypliny, precyzji i nieustannego nadzoru nad technologią, rynkiem i ryzykiem, dlatego powierzyliśmy to zadanie matematycznym algorytmom.

### Opis strategii inwestycyjnej opartej na automatycznym inwestowaniu algorytmicznym

Projekt **ALGO INVEST AI** to nowoczesna inicjatywa inwestycyjna Green Valley ASI S.A., wykorzystująca zaawansowane algorytmy sztucznej inteligencji do podejmowania decyzji inwestycyjnych na rynkach finansowych. Celem projektu jest **maksymalizacja zysków przy jednoczesnym ograniczeniu ryzyka**, dzięki pełnej automatyzacji procesu inwestycyjnego oraz eliminacji wpływu emocji ludzkich.

#### Charakter dokumentu

Niniejszy dokument zawiera kluczowe informacje dotyczące:

- zasad działania algorytmicznych strategii inwestycyjnych,
- parametrów i warunków inwestycji,
- ryzyk związanych z inwestowaniem,
- struktury projektu ALGO INVEST AI,
- Wyniki historyczne strategii algorytmicznej.

#### Wyniki historyczne strategii wzorcowej za ostatnie 12 miesięcy.



### Strategie inwestycyjne wspomagające inwestorów

**Strategia Bursztynowa (konserwatywna)** - to flagowy model inwestycyjny, stworzony z myślą o inwestorach poszukujących przewidywalnych zysków i pełnej automatyzacji. Oferuje dużą stabilność inwestycyjną dzięki ograniczeniu ekspozycji tylko do surowców takich jak złoto, ropa czy srebro. Benchmark bazowy zysku dla strategii to 24% w skali roku. Poziom udziału inwestora w stracie do 10% wartości inwestycji. Dla wyników poniżej benchmarku dodatkowa inwestor może otrzymać premię uzupełniającą wynik netto.

**Strategia Ametystowa (zrównoważona)** - ten model strategii inwestycyjnej nastawiony jest na wychwytywanie najlepszych okazji „Best Momentum”. Stworzony z myślą o inwestorach akceptujących zwiększone ryzyko ale oczekujących wyższych „wygranych”. Strategia skupia się na szerokiej ekspozycji od surowców po indeksy giełdowe. Benchmark bazowy zysku dla strategii to 36% w skali roku. Poziom udziałów w stracie do 20%. Dla wyników ponad benchmark dodatkowa premia w wysokości do 20% wyniku netto.

**Strategia Szmaragdowa (Agresywna)** - to już oferta dla wytrawnych graczy, wymagająca aktywnego zarządzania. W ramach tej strategii do dotychczasowych aktywów w ekspozycji biorą udział BTC czy pary walutowe. Strategia nie ma wyznaczonego benchmark'a co oznacza, że wyniki są dynamiczne i ustalone w cyklach miesięcznych. Poziom udziału inwestora stracie może sięgać do 100% wartości inwestycji. Dla tej strategii inwestor ma możliwość uzyskania bezpośredniego dostępu do platformy inwestycyjnej i udziału w zarządzaniu kontem.

Informacja prawna: Fundusz działa zgodnie z przepisami dotyczącymi Alternatywnych Spółek Inwestycyjnych (ASI) i jest nadzorowany przez Komisję Nadzoru Finansowego. ASI nie prowadzi lokat terminowych opisanych w art. 49 ust. 1, 2 i 3 ustawy z dnia 29 sierpnia 1997 r. - Prawo Bankowe (DZ. U. z 2022 r. poz. 2324 z późn. zmianami, dalej: „prawo bankowe”) będących rodzajem rachunków bankowych objętych gwarancjami Bankowego Funduszu Gwarancyjnego. Szczegółowe informacje zawarte są w umowach i regulaminach Lokat inwestycyjnych. Fundusz nie gwarantuje realizacji celu inwestycyjnego oraz osiągnięcia określonego wyniku. Inwestor Funduszu musi liczyć się z możliwością utraty przynajmniej części wpłaconych środków.



ALTERNATYWNY FUNDUSZ  
INWESTYCYJNY

Plac Bankowy 2, 00-095 Warszawa  
KRS: 0000853159, REGON: 385799364, NIP: 5252831068  
numer rejestru KNF: PLZASI00132, IRS GIIN: TGG1L6.99999.SL.616

# NASZE ALGORYTMY. PAŃSTWA PRZEWAGA.

Budujemy inteligentne algorytmy inwestycyjne, które łączą matematykę, dane i AI, aby podejmować lepsze decyzje – szybciej, konsekwentniej, bez emocji.



## DANE + AI

Przetwarzamy ogromne ilości danych rynkowych i alternatywnych.



## MODELE MATEMATYCZNE

Nasze autorskie modele wylapują przewagę tam, gdzie inni ich nie widzą.



## UCZENIE MASZYNOWE

AI adaptuje się do zmian rynkowych i stale poprawia skuteczność.



## DYSCYPLINA SYSTEMU

Egzekucja bez emocji, zarządzanie ryzykiem na każdym poziomie.



## JAK DZIAŁA NASZA MASZYNA?

Wykrywamy przewagę statystyczną i przekładamy ją na decyzje inwestycyjne.



### 1. SYGNAŁ (EDGE)

Model przewiduje przyszły zwrot lub prawdopodobieństwo ruchu na podstawie cech rynkowych.



### 2. SIŁA SYGNAŁU

Określamy siłę przekonania modelu (im wyższa, tym większa pozycja).

$$S_t \in [-1, 1]$$



### 3. OPTIMALNA POZYCJA

Wyznaczamy wielkość pozycji w sposób optymalny, biorąc pod uwagę pewność i ryzyko.



### 4. EGZEKUCJA I MONITORING

Realizujemy zlecenia, monitorujemy ryzyko w czasie rzeczywistym, uczymy się i optymalizujemy dalej.

## RDZEŃ MODELU – WZÓR

Optymalna pozycja:

$$W_t^* = \frac{K \cdot S_t}{\sigma_t^2 + \lambda}$$

gdzie:

- $W_t^*$  – optymalna wielkość pozycji w chwili  $t$
- $S_t$  – siła sygnału (przewidywana przewaga)
- $\sigma_t^2$  – przewidywana zmienność (ryzyko)
- $K$  – skalowanie agresywności (kontrola dźwigni)
- $\lambda$  – współczynnik awersji do ryzyka (regularyzacja)

## CO TO DAJE INWESTOROWI?



### PRZEWAGA STATYSTYCZNA

Łączymy dane, AI i matematykę, by znajdować nieefektywności rynkowe.



### KONSEKWENTNOŚĆ

System działa 24/7 bez emocji, trzymając się twardych zasad.



### ZARZĄDZANIE RYZYKIEM

Każda pozycja dopasowana do aktualnego ryzyka i celów inwestycyjnych.



### ADAPTACJA I UCZENIE

Modele uczą się w czasie, dostosowując do zmieniających się warunków rynkowych.



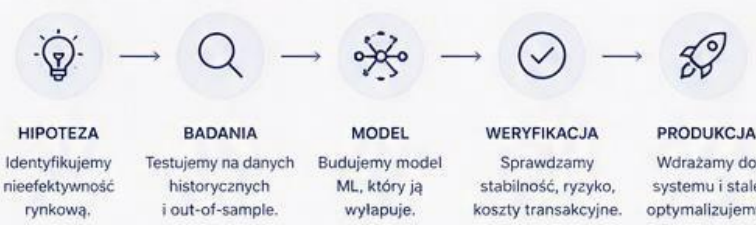
### PEŁNA TRANSPARENTNOŚĆ

Wiemy, dlaczego system podjął decyzję – wszystko jest mierzalne i audytowalne.

## ARCHITEKTURA SYSTEMU



## PROCES TWORZENIA PRZEWAGI



## ZARZĄDZANIE RYZYKIEM – NA KAŻDYM POZIOMIE

- RYZYSKO PORTFELA**  
Limity VaR, ekspozycji netto, koncentracji, sektorów.
- RYZYSKO MODELU**  
Testy stabilności, analiza dryfu danych, walidacja out-of-sample.
- RYZYSKO TRANSAKCYJNE**  
Modele kosztów, płynność, slippage, minimalizacja impactu.
- RYZYSKO OPERACYJNE**  
Automatyczne kontrole, redundancja, monitoring 24/7.