

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR		
(bps)		
45,19	Ações	-1,31%
6,05	Commodities Agrícolas	-0,74%
2,97	Commodities Industriais	-0,11%
3,60	Índices de Ações	0,76%
0,89	Juros	-0,27%
6,31	Moedas	0,93%
3,30	Volatilidade	0,03%
0,37	Caixa e Despesas	0,12%

* VaR = Value at Risk (valor para a classe de ativo isolada). Probabilidade de perda estimada para 1 dia, com 95% de confiança, janela de observações dos últimos 24 meses, e lambda de 0,94, VaR para o fundo total = 69,24 bps

INFORMAÇÕES DO PRODUTO

Gerais

Início do Fundo: 13/07/2021
 Administrador: BNY MELLON
 Gestor: DAEMON INVESTIMENTOS
 Custódia: BANCO BNY MELLON
 Controladoria: BANCO BNY MELLON
 Auditor: KPMG

Outros

Código ANBIMA: 599506
 Classificação: Multimercado Livre
 Perfil de Risco: Arrojado
 Cota: Fechamento
 Patrimônio: R\$ 20.254.596,04
 Tributação-Alvo: Longo Prazo

RATING MORNINGSTAR



(Alternativos – Multiestratégia 10 anos)
 Data de avaliação: 29/03/2022

Investidores

Público-Alvo: Investidores Qualificados
 Situação: Aberto
 Taxa de Administração: 1,70% a.a.
 Taxa de Performance: 17% do que exceder 100% do CDI
 Inv inicial Mínimo: R\$ 5.000.000
 Aplicação / Resgate: até 14hs
 Cotização / Pagto: D+15 / D+18

Contato

ri@daemoninvestimentos.com.br
 www.daemoninvestments.com
 Linkedin.com/daemoninvestments
 @daemoninvestments
 youtube.com/daemoninvestments

DISCLAIMERS

Este fundo não está disponível para investidores norte-americanos, conforme definição legal aplicável, ou qualquer pessoa agindo em nome de um investidor norte-americano. Este documento não é uma oferta, solicitação ou recomendação para vender ou comprar qualquer ativo. A rentabilidade passada ou simulada não representa garantia de resultados futuros. É recomendável buscar aconselhamento profissional e ler o regulamento do fundo disponível em www.cvm.gov.br. Não há garantia de que qualquer investimento vá resultar em lucros ou não vá resultar em perdas ou obrigações adicionais. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor da carteira, com qualquer mecanismo de seguro ou com o Fundo Garantidor de Crédito- FGC. Não há garantia de que este fundo terá tratamento tributário para fundos de longo prazo. É recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses para avaliação da performance do fundo de investimento, Estas informações não têm o objetivo de substituir qualquer consultoria de investimento, financeira, jurídica, regulatória, contábil, tributária ou de outro profissional. A Daemon e suas partes relacionadas não se responsabilizam pela integridade ou precisão dessas informações ou por quaisquer danos ou perdas decorrentes de qualquer uso deste documento.

