



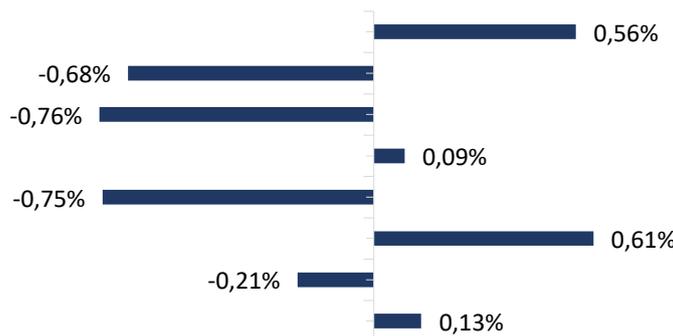
## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

### EXPOSIÇÃO AO RISCO

### CLASSE DE ATIVO

### RETORNO DO MÊS

VaR (bps)	CLASSE DE ATIVO
<b>53,27</b>	Ações
<b>14,52</b>	Commodities Agrícolas
<b>0,99</b>	Commodities Industriais
<b>4,57</b>	Índices de Ações
<b>1,90</b>	Juros
<b>17,16</b>	Moedas
<b>2,82</b>	Volatilidade
<b>0,46</b>	Caixa e Despesas



\* 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 = 92,81 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\$ 19.950.567,59

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](http://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.

