



## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR		
(bps)		
<b>24,63</b>	Ações	-1,68%
<b>20,53</b>	Commodities Agrícolas	1,14%
<b>11,16</b>	Commodities Industriais	-0,76%
<b>6,88</b>	Índices de Ações	-0,12%
<b>7,91</b>	Juros	-0,42%
<b>23,37</b>	Moedas	-0,61%
<b>0,18</b>	Volatilidade	0,26%
<b>0,00</b>	Caixa e Despesas	0,18%

\* 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 = 94,40 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\$ 20.155.690,61  
 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.

