



## 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)		
<b>21,31</b>	Ações	0,29%
<b>5,81</b>	Commodities Agrícolas	-0,27%
<b>0,40</b>	Commodities Industriais	-0,29%
<b>1,83</b>	Índices de Ações	0,04%
<b>0,76</b>	Juros	-0,27%
<b>6,86</b>	Moedas	0,24%
<b>1,13</b>	Volatilidade	-0,08%
<b>0,18</b>	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 = 37,12 bps

## INFORMAÇÕES DO PRODUTO

## Gerais

Início do Fundo: 28/09/2023  
 Administrador: BNY MELLON  
 Gestor: DAEMON INVESTIMENTOS  
 Custódia: BANCO BNY MELLON  
 Controladoria: BANCO BNY MELLON  
 Auditor: KPMG  
 Consultor: ICATU

## Investidores

Público-Alvo: Investidores Qualificados  
 Situação: Aberto  
 Taxa de Administração: 1,50% a.a.  
 Taxa de Administração Máxima: 2,50% a.a.  
 Taxa de Performance: 20% do que exceder 100% do CDI  
 Inv inicial Mínimo: Não há  
 Aplicação / Resgate: até 14hs  
 Cotização / Pagto: D+7/ D+10

## Outros

Código ANBIMA: 724106  
 Classificação: Previdência Multimercado Livre  
 Perfil de Risco: Arrojado  
 Cota: Fechamento  
 Patrimônio: R\$ 46.384.643,51  
 Tributação-Alvo: Longo Prazo

## 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. É recomendável buscar aconselhamento profissional e ler o prospecto e o regulamento do fundo disponível em <https://www.gov.br/cvm>. Estas informações não têm o objetivo de substituir qualquer consultoria de investimento, financeira, jurídica, regulatória, contábil, tributária ou de outro profissional. A rentabilidade passada ou simulada não representa garantia de resultados futuros. 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. 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. Este fundo tem menos de 12 (doze) meses, para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses.

