

## DAEMON ETHOS PREV

É um fundo previdenciário diversificado e balanceado que explora fatores de risco no Brasil e no exterior, de maneira sistemática.

## FILOSOFIA DE INVESTIMENTO

Somos recompensados por tomar riscos mal precificados. Buscamos retornos absolutos não correlacionados com o mercado.

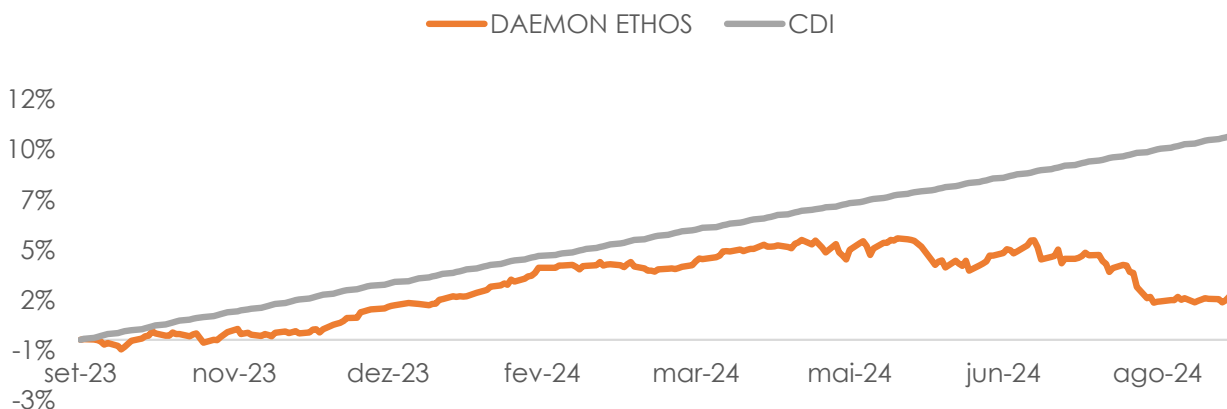
## Comentário do Gestor

O Daemon Ethos apresentou um retorno negativo de -0,98% em agosto, acumulando 0,63% no ano. O mês foi marcado pelo avanço de Kamala Harris nas pesquisas eleitorais e pela forte volatilidade nos mercados. A candidata democrata arrecadou cerca de US\$ 200 milhões em uma semana de campanha e assumiu a liderança nas últimas pesquisas eleitorais, o que acabou influenciando o sentimento de mercado e alguns setores em particular. No mercado de petróleo, a escalada de conflitos no Oriente Médio, a expectativa de desaceleração econômica global e os cortes de produção geraram fortes oscilações no preço da commodity. Como resultado dos eventos globais, o VIX teve sua maior oscilação intradiária da história ao subir 42,3 pontos, causando uma reversão momentânea no mercado. O Daemon Ethos, foi negativamente impactado pela volatilidade dos mercados, e apenas as estratégias em commodities industriais fecharam positivas.



Acesse o conteúdo completo!

## Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 3,49%/3,06%.

## Rentabilidade Mensal

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM.
<b>2023</b> Fundo									0,03%	0,24%	0,16%	1,30%	1,73%	1,73%
%CDI									60%	24%	18%	145%	60%	60%
<b>2024</b> Fundo	1,01%	0,98%	0,26%	0,89%	-0,28%	-0,23%	-0,98%	-0,98%					0,63%	3,39%
%CDI	104%	122%	31%	100%	-	-	-	-					9%	23%

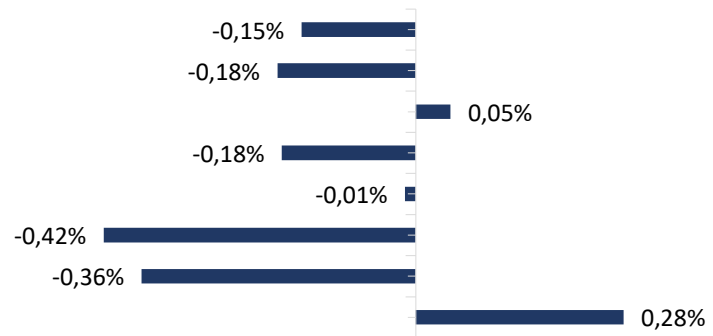
## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

## EXPOSIÇÃO AO RISCO

## CLASSE DE ATIVO

## RETORNO DO MÊS

VaR	
(bps)	
<b>24,88</b>	Ações
<b>1,73</b>	Commodities Agrícolas
<b>2,07</b>	Commodities Industriais
<b>0,21</b>	Índices de Ações
<b>2,70</b>	Juros
<b>0,46</b>	Moedas
<b>0,06</b>	Volatilidade
<b>0,13</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 = 31,20 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\$ 12.013.962,89  
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.

