

Ethos Prev Icatu FIE I

CNPJ: 50.698.062/0001-97

Outubro/2024

DAEMON
investments

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.

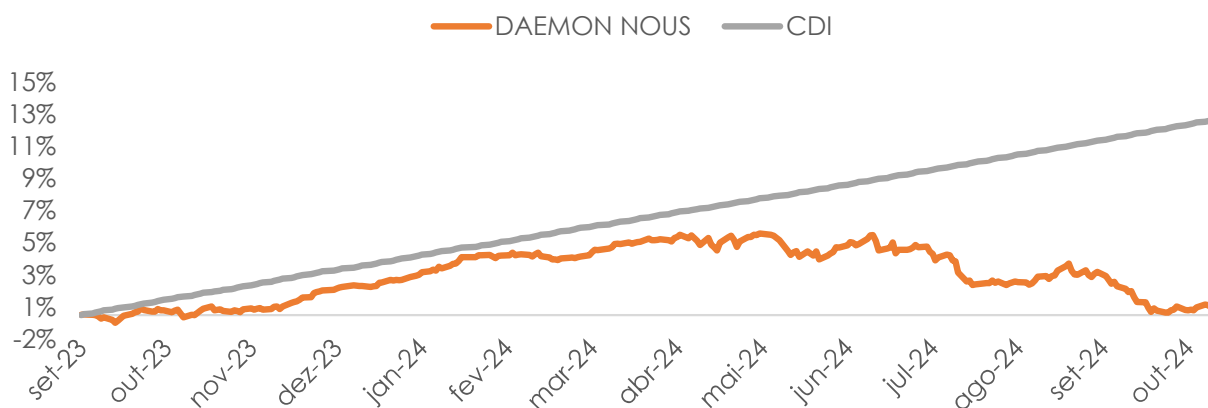
Comentário do Gestor

O Daemon Ethos registrou retorno negativo de 1,28% em outubro, acumulando -1,38% no ano. No mês, o corte de juros na Europa e novos estímulos na China foram destaques. O Banco Central Europeu reduziu a taxa de depósitos em 25 bps, buscando impulsionar a economia. Na China, após um rally inicial, as bolsas caíram com dados de recuperação abaixo do esperado, mas novas medidas de liquidez sustentaram alta na segunda metade do mês. A volatilidade aumentou com conflitos no Oriente Médio e o cenário eleitoral nos EUA, impactando o mercado de energia e pressionando o desempenho do fundo, principalmente as estratégias de ações e juros.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 2,78%/3,08%.

Rentabilidade Mensal

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM.
2023 Fundo									0,03%	0,24%	0,16%	1,30%	1,73%	1,73%
%CDI									60%	24%	18%	145%	60%	60%
2024 Fundo	1,01%	0,98%	0,26%	0,89%	-0,28%	-0,23%	-0,98%	-0,98%	-0,73%	-1,28%			-1,38%	0,32%
%CDI	104%	122%	31%	100%	-	-	-	-	-	-			-	3%

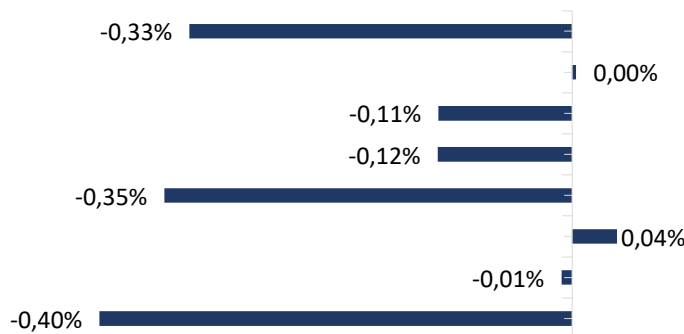
RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

VaR (bps)	CLASSE DE ATIVO
11,13	Ações
4,03	Commodities Agrícolas
5,00	Commodities Industriais
2,76	Índices de Ações
1,11	Juros
6,00	Moedas
0,41	Volatilidade
0,02	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 = 30,42 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\$ 3.440.107,94
 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.

