

Ethos Prev Icatu FIE I

CNPJ: 50.698.062/0001-97

Novembro/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.

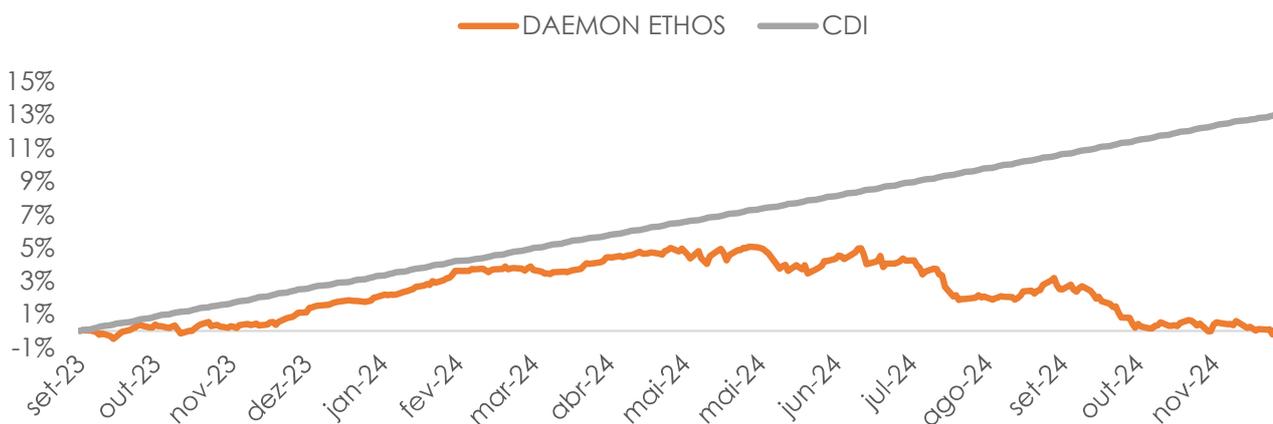
Comentário do Gestor

O mês de novembro foi marcado por acontecimentos econômicos e geopolíticos significativos. Nos Estados Unidos, a reeleição de Donald Trump, com maioria republicana no Congresso, dominou o cenário político e econômico, trazendo expectativas de reformas fiscais, cortes de regulamentações e tarifas comerciais. Essas medidas alimentaram volatilidade nos mercados, acompanhada pela valorização do dólar e elevação das taxas de juros de longo prazo. No âmbito global, as tensões geopolíticas se intensificaram com a escalada do conflito entre Rússia e Ucrânia e a reconfiguração das alianças energéticas. Na China, dados econômicos mistos refletiram desafios contínuos para a retomada do crescimento. Já no Brasil, o dólar atingiu a máxima histórica frente ao real, refletindo as incertezas sobre a sustentabilidade das contas públicas. O Daemon Ethos encerrou o mês em baixa de 0,07%.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 3,66%/3,12%.

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%	-0,07%		-1,46%	0,25%
%CDI	104%	122%	31%	100%	-	-	-	-	-	-	-		-	2%

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)		
8,96	Ações	0,49%
2,98	Commodities Agrícolas	-0,35%
0,43	Commodities Industriais	-0,15%
0,20	Índices de Ações	0,04%
3,67	Juros	0,12%
12,27	Moedas	0,13%
0,09	Volatilidade	-0,01%
0,59	Caixa e Despesas	-0,36%

* 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 = 29,16 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\$ 2.621.193,98
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.

