

DAEMON NOUS GLOBAL

É UM FUNDO MULTIMERCADO 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.

INFORMAÇÕES DO PRODUTO

Gerais

Início do Fundo: 26/02/2020
Administrador: BNY MELLON
Gestor: DAEMON INVESTIMENTOS
Custódia: BANCO BNY MELLON
Controladora: BANCO BNY MELLON
Auditor: KPMG

Investidores

Público-Alvo: Investidores Qualificados
Situação: Aberto
Taxa de Administração: 2,00% a.a.
Taxa de Performance: 20% do que exceder 100% do CDI
Inv inicial Mínimo: R\$ 10.000
Aplicação / Resgate: até 14hs
Cotização / Pagto: D+15 / D+18

Outros

Código ANBIMA: 530042
Classificação: Multimercado Livre
Perfil de Risco: Arrojado
Cota: Fechamento
Patrimônio: R\$ 83.855.672,71
Tributação-Alvo: Longo Prazo

Em 04/05/2021 o Daemon Nous Global FIM foi transformado em um **Feeder**, e teve seu regulamento modificado. O desempenho anterior a esta data não leva em conta fatores importantes, como custos com taxas de administração e performance.

NOTAS

1: A volatilidade é o desvio padrão simples dos retornos por períodos rolados de 21 dias úteis

2: Correlação dos retornos do Nous Global com outros ativos por períodos rolados de 63 dias úteis

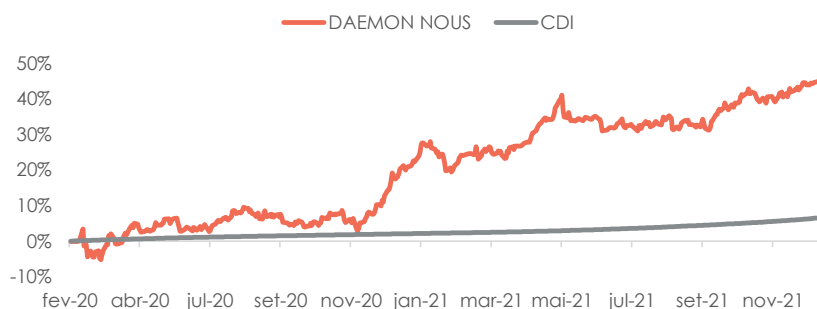
CNPJ: 34.702.572/0001-34

DEZEMBRO 2021

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	3,00%	393%	6,42%	4,61
12 meses	18,37%	418%	10,78%	1,30
Início	44,73%	677%	12,58%	1,49

DESEMPENHO

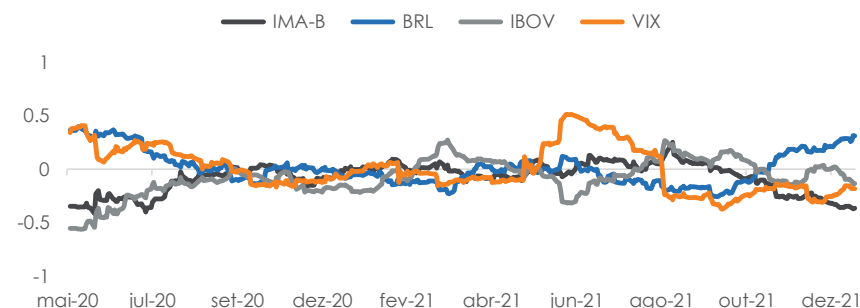
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br



COMENTÁRIO DO GESTOR

Em dezembro, o Nous Global apresentou um retorno positivo de 3,00%. Com esse resultado, o fundo acumulou 18,37% de retorno em 2021, isto é, 418% do CDI, com índice Sharpe de 1,30. Dezembro foi marcado pela aceleração da retirada dos estímulos monetários nos EUA e pela elevação das taxas de juros por outros bancos centrais. Como haviam sido sinalizados ainda no mês passado, tais eventos já estavam incorporados nos preços dos ativos. A retirada de liquidez coincidiu, porém, com o surgimento de uma nova variante (Ômicron), o que, combinado com a estagnação do número de vacinados nos países desenvolvidos e a indisponibilidade de vacinas para países do continente africano, acabou aumentando a volatilidade nos mercados. Os destaques do mês foram as estratégias de ações Brasil, commodities agrícolas e moedas, com retornos de 2,47%, 0,74% e 0,59%, respectivamente. Também fecharam positivas em dezembro as estratégias de índices de ações, 0,26%, e volatilidade, 0,15%. Os destaques negativos foram as posições em juros e commodities industriais que acumularam -0,43% e -0,40% no mês, respectivamente.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO*		CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
GROSS	NET		
94%	13%	Ações	2.47%
33%	29%	Commodities agrícolas	0.74%
8%	5%	Commodities industriais	-0.40%
19%	18%	Índices de ações	0.26%
1491%	-780%	Juros	-0.43%
116%	-71%	Moedas	0.59%
1%	-1%	Volatilidade	0.15%
59%	53%	Caixa, despesas e outros	-0.38%

* As exposições são calculadas com base nos *notionals* das posições e não são uma boa representação do risco alocado nas classes de ativo.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI
2020		-0,07%	-0,93%	3,50%	3,74%	-3,37%	6,36%	-1,88%	-2,82%	0,73%	4,83%	10,88%	22,27%	1053%
2021	-2,07%	2,69%	3,05%	5,87%	-0,24%	-0,92%	-0,40%	1,31%	2,41%	3,55%	-0,97%	3,00%	18,37%	418%



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. 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.