

## 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  
Controladoria: 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\$ 142.036.346,08  
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

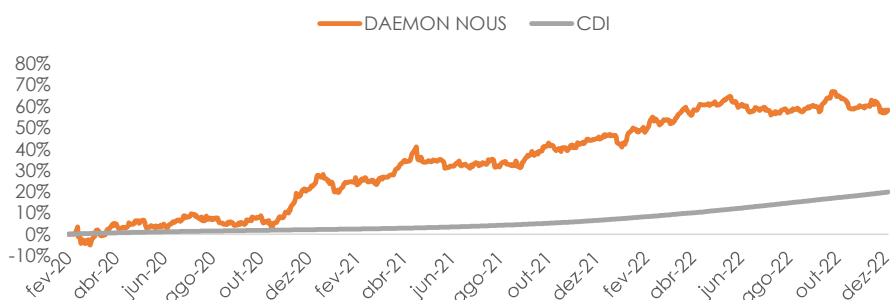
CNPJ: 34.702.572/0001-34

DEZEMBRO 2022

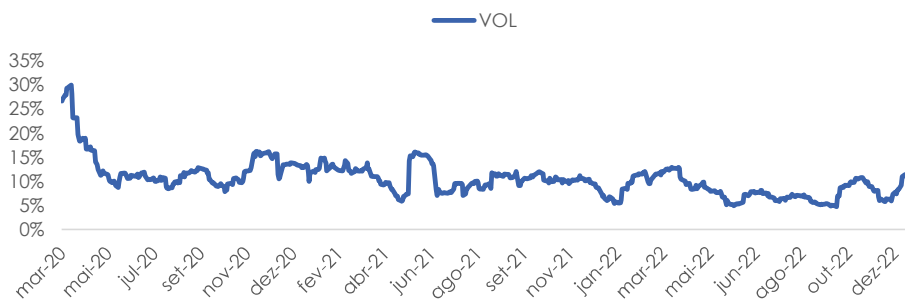
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-0,60%	-	11,85%	-1,71
Ano	9,28%	75%	8,72%	-0,36
12 meses	9,28%	75%	8,72%	-0,36
Início	58,15%	294%	11,39%	0,96

## DESEMPENHO

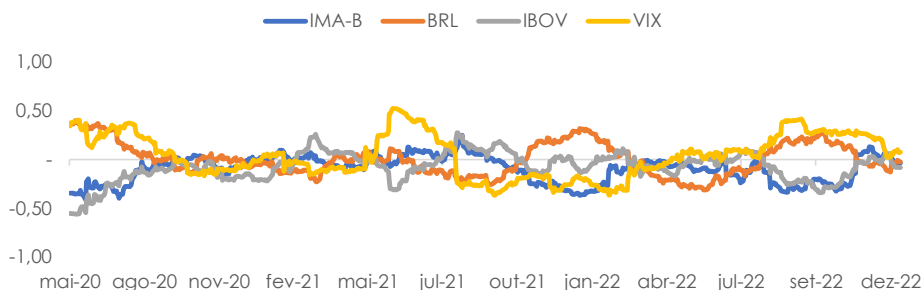
### RENTABILIDADE



### VOLATILIDADE <sup>1</sup>



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br



Em dezembro, o Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de -0,60%, fechando o ano com retorno de 9,28%. 2022 foi um ano desafiador para os mercados globais e a política monetária americana acabou sendo uma das principais causas de incerteza e volatilidade nas bolsas. A flexibilização das restrições contra o COVID-19 na China e o anúncio do Banco Central Japonês de que dobraria o limite superior de negociação dos títulos de 10 anos marcaram alguns os mercados durante mês de dezembro. Os destaques positivos do Nous foram commodities industriais, ações e volatilidade que acumularam 1,57%, 0,87% e 0,40%, respectivamente. Já os destaques negativos foram juros, moedas, índices de ações e commodities agrícolas que acumularam -1,86%, -0,76%, -0,73% e -0,20%, respectivamente.

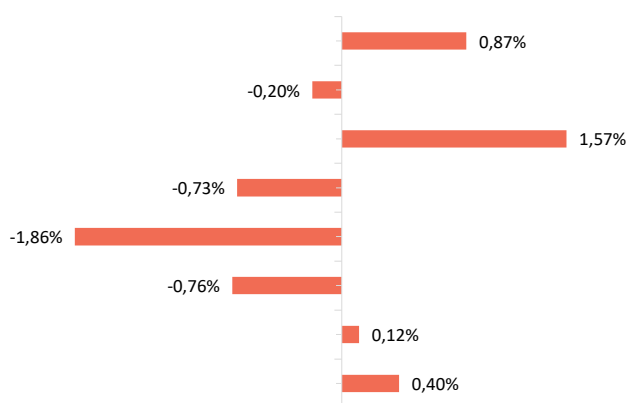
## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

### EXPOSIÇÃO AO RISCO

### CLASSE DE ATIVO

### RETORNO DO MÊS

VaR (bps)	CLASSE DE ATIVO
83,49	Ações
34,83	Commodities Agrícolas
32,45	Commodities Industriais
7,91	Índices de Ações
16,82	Juros
15,83	Moedas
7,50	Volatilidade
0,00	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 = 110,53 bps

## HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI
<b>2020</b>		-0,07%	-0,93%	3,50%	3,74%	-3,37%	6,63%	-1,88%	-2,82%	0,73%	4,83%	10,88%	<b>22,27%</b>	<b>1053%</b>
<b>2021</b>	-2,07%	2,69%	3,05%	5,87%	-0,24%	-0,92%	-0,40%	1,31%	2,41%	3,55%	-0,97%	3,00%	<b>18,37%</b>	<b>418%</b>
<b>2022</b>	-1,76%	3,83%	3,21%	3,87%	1,66%	-0,61%	-0,88%	-0,25%	1,00%	2,81%	-3,08%	-0,60%	<b>9,28%</b>	<b>75%</b>



### 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](http://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.