

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\$ 149.828.418,86
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

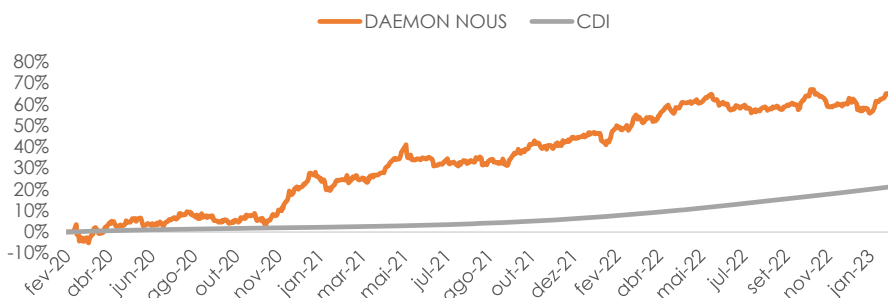
CNPJ: 34.702.572/0001-34

JANEIRO 2023

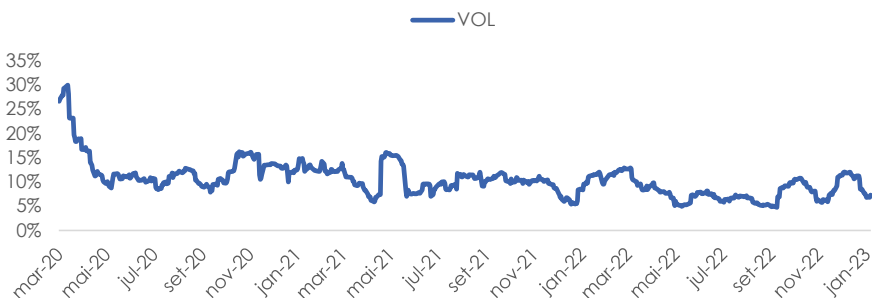
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	3,74%	333%	7,28%	5,30
Ano	3,74%	333%	7,28%	5,30
12 meses	15,39%	120%	8,52%	0,30
Início	64,06%	303%	11,29%	1,03

DESEMPENHO

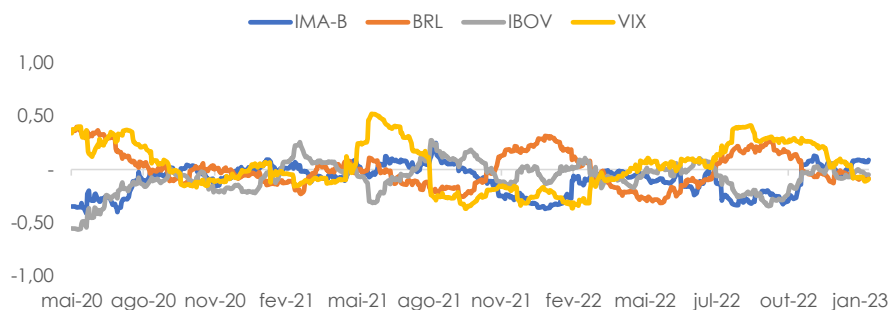
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br

COMENTÁRIO DO GESTOR



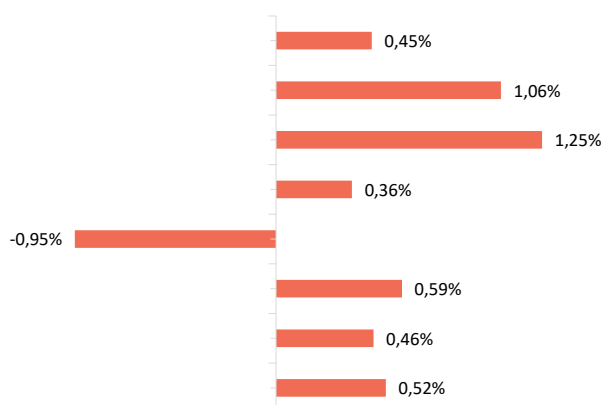
O Daemon Nous Global apresentou um retorno positivo de 3,74% em janeiro, acumulando um retorno de 15,39% em 12 meses e 303% do CDI desde o início do fundo. 2023 começou muito bem para as bolsas globais. Após um ano difícil, as bolsas mostraram uma forte recuperação em janeiro, dando o tom *bullish* para os demais mercados. De fato, a recuperação foi observada em commodities, desde grãos até energia, passando por metais, em moedas – tanto G10 como EM se valorizaram frente ao dólar e até as taxas de juros recuaram. Na economia, os dados mostram que a atividade econômica nos Estados Unidos segue resiliente e a inflação continua dando sinais de que está enfraquecendo. Ainda é cedo para o *Federal Reserve* declarar vitória, mas o horizonte da política monetária vai ficando mais claro. A curva de juros americana precifica o início dos cortes já para o final deste ano. Os destaques do mês foram as estratégias de commodities industriais, commodities agrícolas, moedas e volatilidade, com retornos de 1,25%, 1,06%, 0,59% e 0,46%, respectivamente. A única estratégia negativa em janeiro foi a de juros que acumulou -0,95% no mês.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

VaR (bps)	CLASSE DE ATIVO
40,80	Ações
31,67	Commodities Agrícolas
28,48	Commodities Industriais
23,41	Índices de Ações
26,99	Juros
20,36	Moedas
6,31	Volatilidade
0,00	Caixa e despesas

RETORNO DO MÊS



* 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 = 105,13 bps

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%	6,63%	-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%
2022	-1,76%	3,83%	3,21%	3,87%	1,66%	-0,61%	-0,88%	-0,25%	1,00%	2,81%	-3,08%	-0,60%	9,28%	75%
2023	3,74%												3,74%	333%



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.