

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

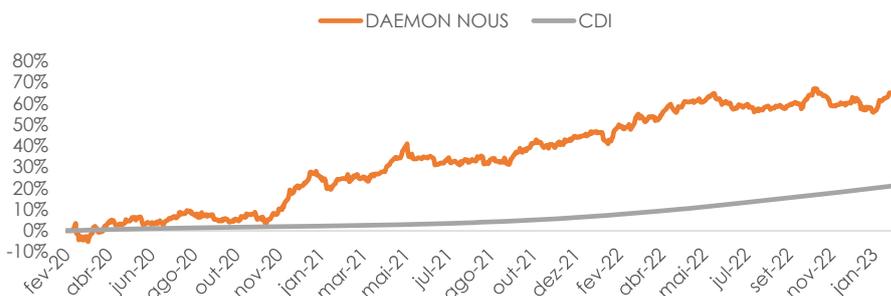
CNPJ: 34.702.572/0001-34

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

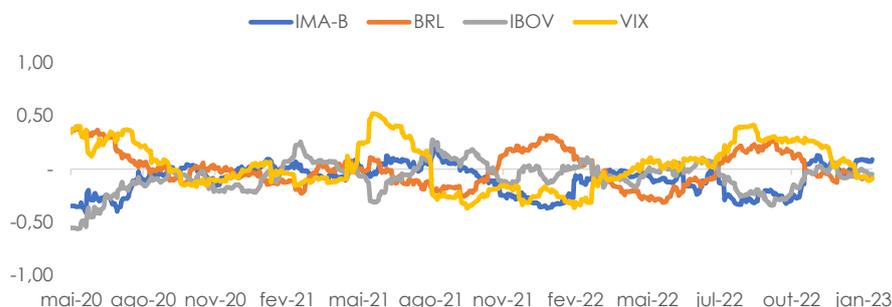
RENTABILIDADE



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

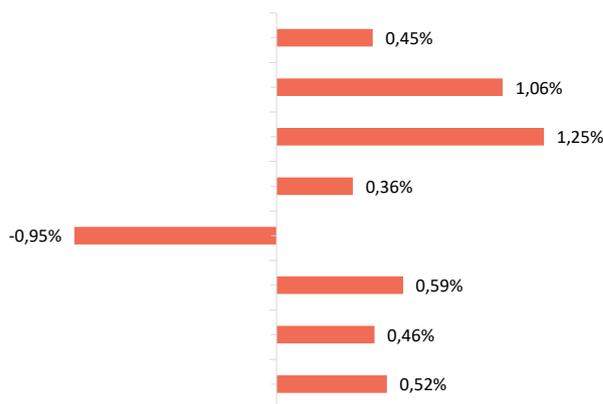
VaR

(bps)

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

CLASSE DE ATIVO

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.