

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\$ 145.004.758,47
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

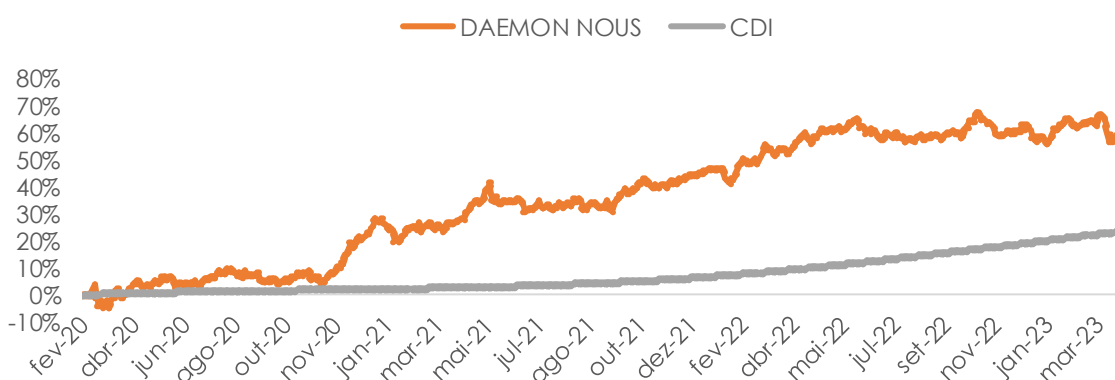
CNPJ: 34.702.572/0001-34

MARÇO 2023

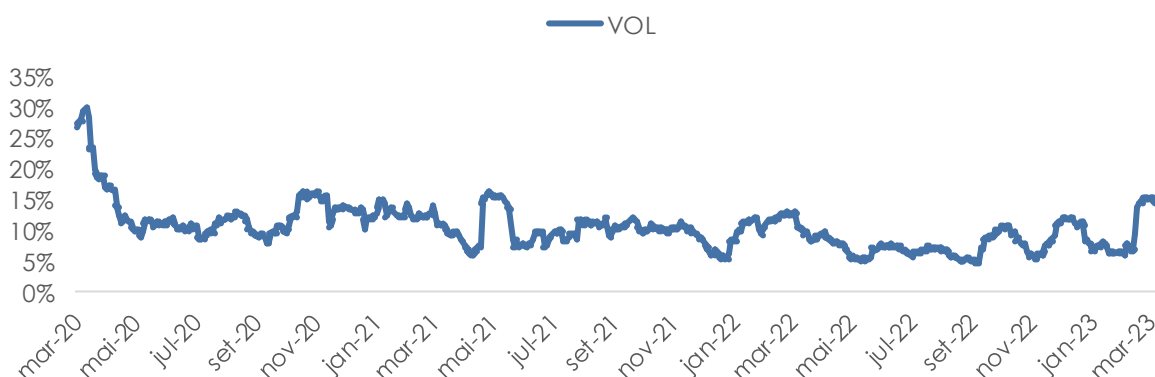
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-1,92%	-	14,35%	-2,28
Ano	1,01%	31%	10,37%	-0,92
12 meses	4,86%	37%	8,52%	-0,99
Início	59,75%	252%	11,28%	0,82

DESEMPENHO

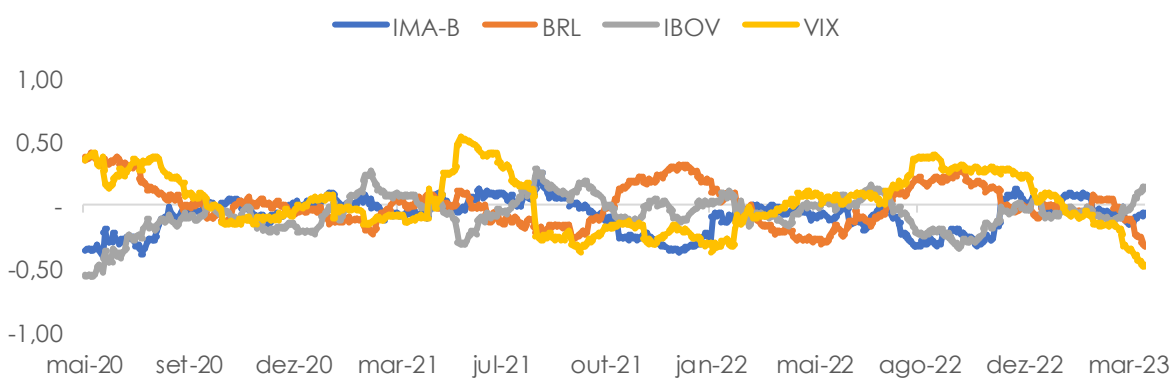
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



COMENTÁRIO DO GESTOR



O Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de 1,92% em março, acumulando um retorno de 252% do CDI desde o início do fundo. Os mercados globais estiveram à beira do precipício quando dois bancos regionais americanos foram a falência. O movimento nas taxas de juros curto prazo foi tão brutal que só vimos um algo similar no crash da bolsa de 1987. Em questão de dias, a trajetória implícita da política monetária na curva de juros mudou de um ciclo de aumento de juros para um ciclo de cortes, com a taxa de 2 anos fechando 100 pontos base. Essa reprecificação nos juros refletiu em todos os mercados, principalmente moedas e commodities. Já nas bolsas o impacto foi mitigado uma vez que o aumento do prêmio de risco foi compensado por juros mais baixos. O Nous Global foi impactado pelo choque de volatilidade nos mercados, mas seus sistemas prontamente rebalancearam as posições para buscar a meta de risco. Os destaques positivos do mês foram as estratégias de commodities agrícolas e ações, com retornos de 1,56% e 0,12%, respectivamente. Por outro lado, as estratégias de juros foram as que mais sofreram com um retorno de -2,23% no mês, seguidas de moedas, índice de ações, volatilidade e commodities industriais com retornos de -1,20%, -0,29%, -0,20% e -0,14% respectivamente.

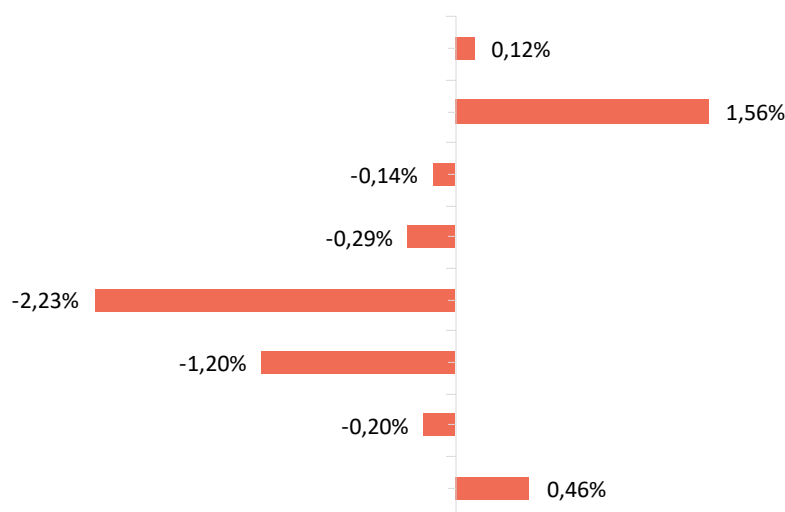
RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

VaR	
(bps)	
71,00	Ações
38,59	Commodities Agrícolas
28,69	Commodities Industriais
5,40	Índices de Ações
28,14	Juros
26,75	Moedas
3,76	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 = 75,41 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%	-0,72%	-1,92%										1,01%	31%



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.