

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\$ 145.053.542,22
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

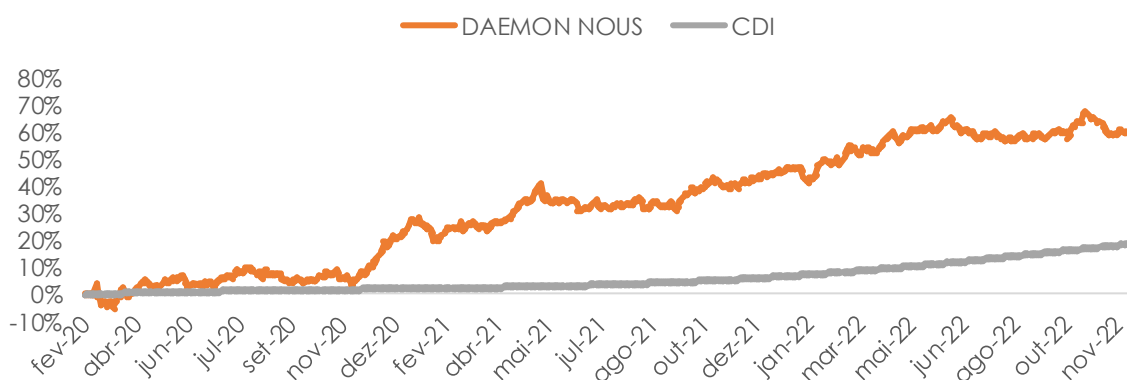
CNPJ: 34,702,572/0001-34

NOVEMBRO 2022

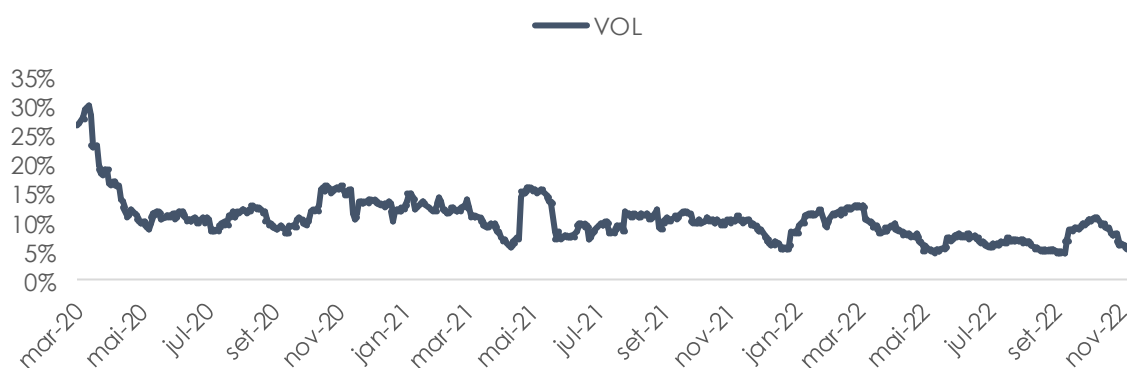
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-3,08%	-	5,77%	-8,01
Ano	9,93%	89%	8,39%	-0,16
12 meses	13,23%	111%	8,27%	0,15
Início	59,10%	320%	11,38%	1,06

DESEMPENHO

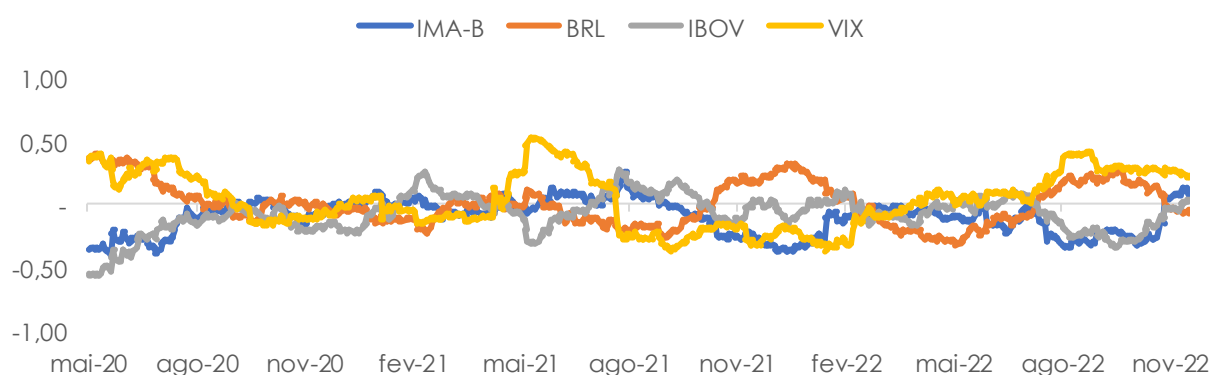
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



COMENTÁRIO DO GESTOR



O Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de -3,08% em novembro, acumulando 13,23% em 12 meses. Novembro foi um mês de alívio e incerteza nos mercados globais. Os dados de inflação sugerem que a inflação americana já atingiu sua máxima e tende a suavizar nos próximos meses, já os dados de atividade sugerem que a economia ainda está muito aquecida e perto do pleno emprego. O Federal Reserve descartou uma possível pausa ou reversão do aperto monetário em curso nos EUA, mas sinalizou que deve reduzir o ritmo na elevação dos juros. A bolsa americana interrompeu a sequência de quedas dos meses anteriores e mostrou uma recuperação no mês de novembro. Houve um movimento de reversão semelhante nos principais ativos de risco, como juros e moedas. Os destaques positivos do mês foram ações, volatilidade e índice de ações com retornos de 1,47%, 0,29% e 0,17%, respectivamente. Já os destaques negativos foram as posições em moedas, commodities industriais, commodities agrícolas e juros que acumularam -3,28%, -1,17%, -0,82% e -0,29% no mês, respectivamente.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR (bps)		
31,48	Ações	1,47%
27,62	Commodities Agrícolas	-0,82%
27,68	Commodities Industriais	-1,17%
20,05	Índices de Ações	0,17%
33,24	Juros	-0,29%
18,08	Moedas	-3,28%
7,09	Volatilidade	0,29%
0,00	Caixa e despesas	0,55%

* 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 = 57,56 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%		9,93%	89%



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.