

# NOUS GLOBAL FEEDER I

CNPJ: 42.287.467/0001-04

ABRIL 2023

**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: 13/07/2021  
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: 1,70% a.a.  
Taxa de Performance: 17% do que  
exceder 100% do CDI  
Inv inicial Mínimo: R\$ 5.000.000  
Aplicação / Resgate: até 14hs  
Cotização / Pagto: D+15 / D+18

### Outros

Código ANBIMA: 599506  
Classificação: Multimercado Livre  
Perfil de Risco: Arrojado  
Cota: Fechamento  
Patrimônio: R\$ 18.204.254,46  
Tributação-Alvo: Longo Prazo

### NOTAS

1: A volatilidade é o desvio padrão simples dos retornos por períodos rolados de 21 dias úteis

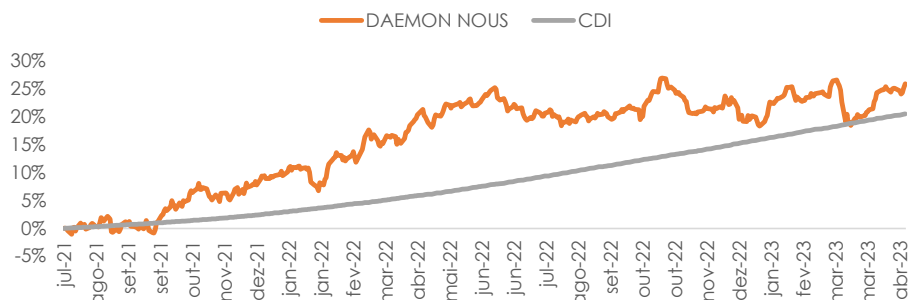
2: Correlação dos retornos do Nous Global com outros ativos por períodos rolados de 63 dias úteis

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
--	---------	-------	-----	--------

Mês	3,83%	417%	6,63%	8,39
Ano	4,79%	114%	9,86%	0,21
12 meses	4,63%	35%	8,49%	-1,04
Início	25,90%	126%	9,27%	0,30

## DESEMPENHO

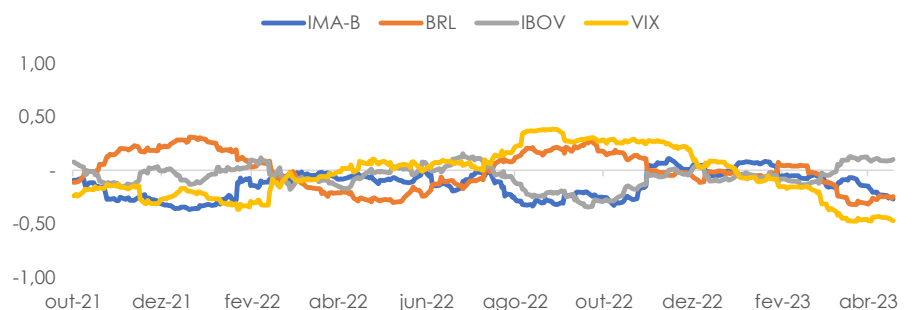
### RENTABILIDADE



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



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



✉ 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 3,83% em abril, acumulando um retorno de 4,79% no ano. Abril foi um mês de indefinição nos principais mercados americanos. Bolsa e juros oscilaram ao longo do mês sem rumo, já certos commodities tanto no setor de energia como no agrícola tiveram fortes movimentos durante o mês, assim como algumas moedas. O mercado passou o mês digerindo a crise nos bancos regionais americanos e buscando sinais sobre os próximos passos da política monetária. A inflação tem cedido mas ainda está num nível extremamente desconfortável para o Fed. Por outro lado, os indicadores de atividade ainda mostram alguma resiliência. Mas tudo indica que o ciclo de aperto monetário está perto do fim. A principal questão agora é quando começam os cortes de juros. Os destaques do mês foram as estratégias de commodities agrícolas, moedas e ações com retornos de 2,07%, 1,78% e 0,79%, respectivamente. Já os destaques positivos foram as estratégias de commodities industriais e juros a de juros que acumularam -0,88% e -0,36% no mês.

## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

### EXPOSIÇÃO AO RISCO

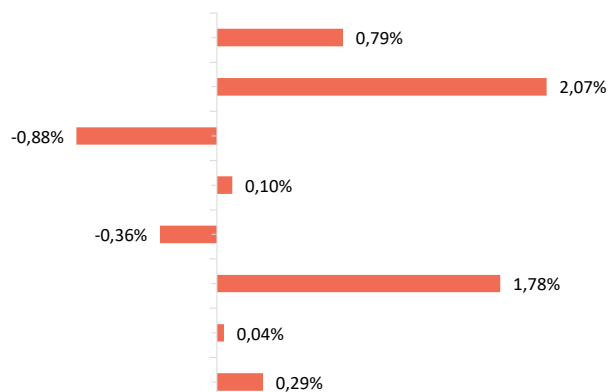
VaR

(bps)

51,05	Ações
47,94	Commodities Agrícolas
27,01	Commodities Industriais
17,89	Índices de Ações
18,15	Juros
46,09	Moedas
5,45	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 = 87,13 bps

## HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI
2021							-0,16%	1,22%	2,45%	3,66%	-1,04%	3,18%	9,58%	326%
2022	-1,66%	3,77%	3,30%	4,04%	1,71%	-0,66%	-0,86%	-0,26%	1,00%	2,85%	-3,10%	-0,60%	9,64%	78%
2023	3,70%	-0,78%	-1,91%	3,83%									4,79%	114%



### 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.