

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
 Controladora: 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\$ 17.429.884,90
 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

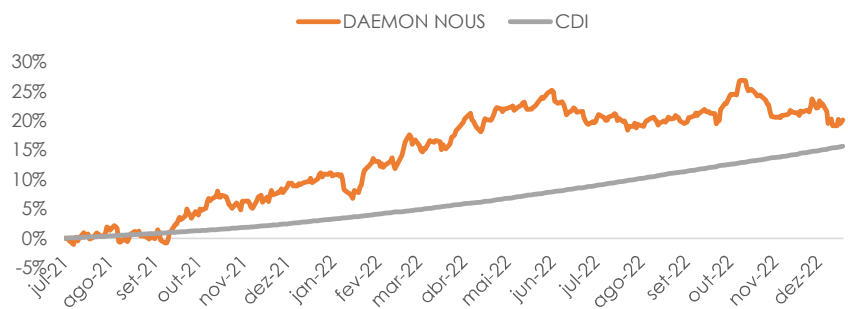
CNPJ: 42.287.467/0001-04

DEZEMBRO 2022

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-0,60%	-	11,89%	-1,71
Ano	9,64%	78%	8,84%	-0,31
12 meses	9,64%	78%	8,84%	-0,31
Início	20,14%	128%	9,16%	0,31

DESEMPENHO

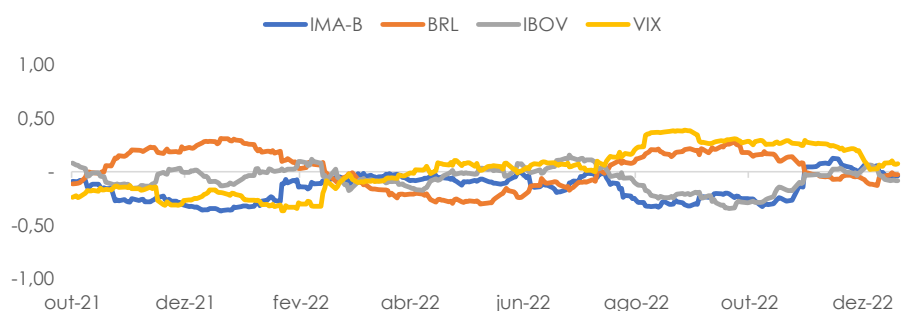
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br

COMENTÁRIO DO GESTOR



Em dezembro, o Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de -0,60%, fechando o ano com retorno de 9,64%. 2022 foi um ano desafiador para os mercados globais e a política monetária americana acabou sendo uma das principais causas de incerteza e volatilidade nas bolsas. A flexibilização das restrições contra o COVID-19 na China e o anúncio do Banco Central Japonês de que dobraria o limite superior de negociação dos títulos de 10 anos marcaram alguns os mercados durante mês de dezembro. Os destaques positivos do Nous foram commodities industriais, ações e volatilidade que acumularam 1,57%, 0,87% e 0,40%, respectivamente. Já os destaques negativos foram juros, moedas, índices de ações e commodities agrícolas que acumularam -1,86%, -0,76%, -0,73% e -0,20%, respectivamente.

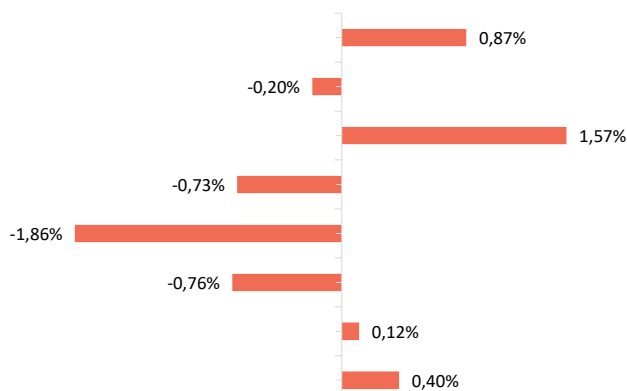
RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

VaR (bps)	CLASSE DE ATIVO
83,49	Ações
34,83	Commodities Agrícolas
32,45	Commodities Industriais
7,91	Índices de Ações
16,82	Juros
15,83	Moedas
7,50	Volatilidade
0,00	Caixa e despesas



* 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 = 110,53 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%



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.