

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\$ 17.874.402,18
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

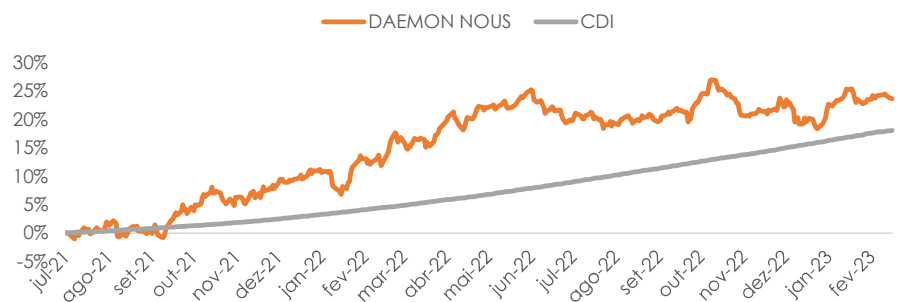
CNPJ: 42.287.467/0001-04

FEVEREIRO 2023

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-0,78%	-	5,93%	-4,04
Ano	2,90%	141%	6,84%	0,88
12 meses	9,70%	74%	8,37%	-0,40
Início	23,62%	131%	8,94%	0,36

DESEMPENHO

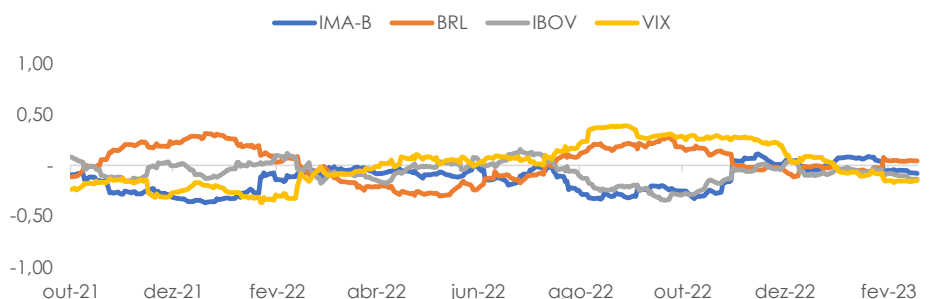
RENTABILIDADE



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 negativo de -0,78% em fevereiro, acumulando um retorno de 2,90% (141% do CDI) no ano. Após um janeiro muito forte, fevereiro foi um mês de correção e incerteza nos mercados globais. Como esperado, o Federal Reserve reduziu o ritmo na elevação dos juros de 50 bps para 25 bps no início do mês. A realidade dos dados, entretanto, se impôs, enfraquecendo o cenário de *soft landing* e mostrando que tanto a atividade econômica quanto a inflação americana seguem resilientes. A bolsa americana devolveu boa parte dos ganhos de janeiro e houve um movimento de reversão semelhante nos principais ativos de risco, como commodities, moedas e juros. Os destaques positivos do mês foram ações, juros e moedas com retornos de 0,67%, 0,07% e 0,02%, respectivamente. Já os destaques negativos foram as posições em commodities agrícolas, índice de ações, commodities industriais e volatilidade que acumularam -1,46%, -0,30%, -0,06% e -0,05% no mês, respectivamente.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

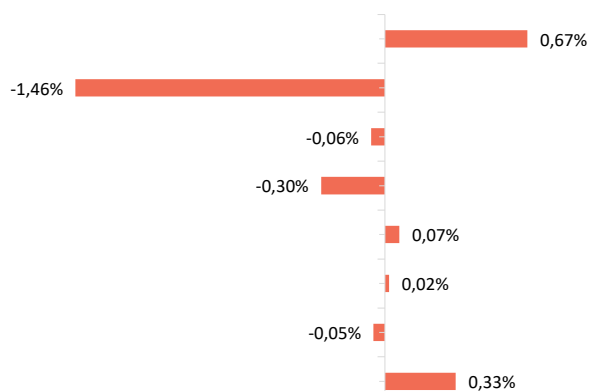
VaR

(bps)

44,10	Ações
21,60	Commodities Agrícolas
27,29	Commodities Industriais
10,47	Índices de Ações
17,41	Juros
18,69	Moedas
4,36	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 = 72,96 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%											2,90%	141%



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.