

## 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\$ 18.014.198,47  
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

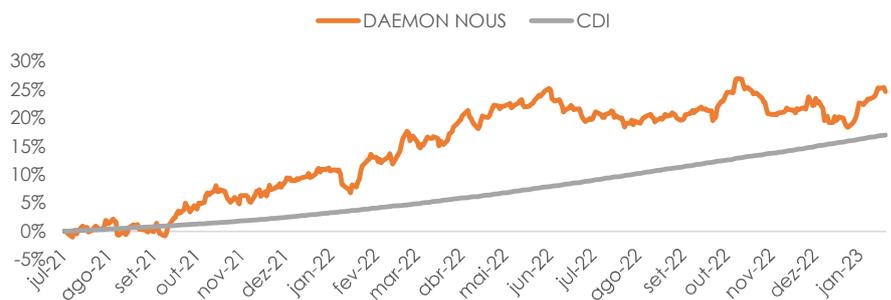
CNPJ: 42.287.467/0001-04

JANEIRO 2023

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	3,70%	329%	7,30%	5,20
Ano	3,70%	329%	7,30%	5,20
12 meses	15,62%	122%	8,66%	0,32
Início	24,59%	145%	9,07%	0,50

## DESEMPENHO

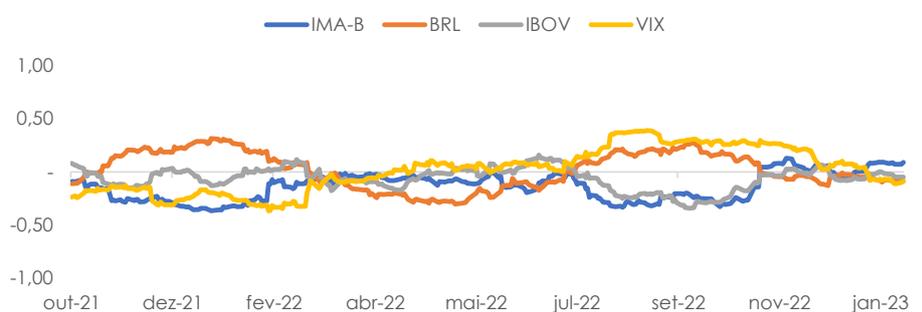
### RENTABILIDADE



### 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 3,70% em janeiro, acumulando um retorno de 15,62% em 12 meses e 145% do CDI desde o início do fundo. 2023 começou muito bem para as bolsas globais. Após um ano difícil, as bolsas mostraram uma forte recuperação em janeiro, dando o tom *bullish* para os demais mercados. De fato, a recuperação foi observada em commodities, desde grãos até energia, passando por metais, em moedas – tanto G10 como EM se valorizaram frente ao dólar e até as taxas de juros recuaram. Na economia, os dados mostram que a atividade econômica nos Estados Unidos segue resiliente e a inflação continua dando sinais de que está enfraquecendo. Ainda é cedo para o *Federal Reserve* declarar vitória, mas o horizonte da política monetária vai ficando mais claro. A curva de juros americana precifica o início dos cortes já para o final deste ano. Os destaques do mês foram as estratégias de commodities industriais, commodities agrícolas, moedas e volatilidade, com retornos de 1,25%, 1,06%, 0,59% e 0,46%, respectivamente. A única estratégia negativa em janeiro foi a de juros que acumulou -0,95% no mês.

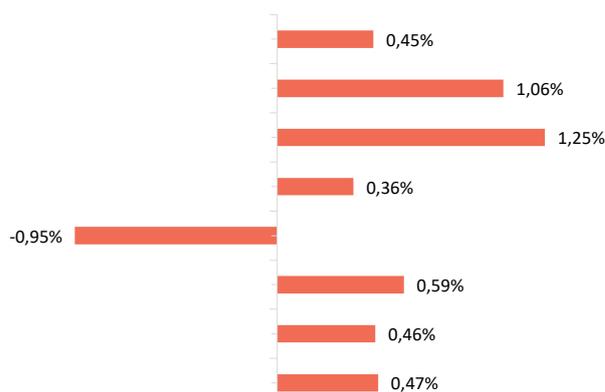
## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

### EXPOSIÇÃO AO RISCO

### CLASSE DE ATIVO

### RETORNO DO MÊS

VaR	
(bps)	
<b>40,80</b>	Ações
<b>31,67</b>	Commodities Agrícolas
<b>28,48</b>	Commodities Industriais
<b>23,41</b>	Índices de Ações
<b>26,99</b>	Juros
<b>20,36</b>	Moedas
<b>6,31</b>	Volatilidade
<b>0,00</b>	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 = 105,13 bps

## HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI
<b>2021</b>							-0,16%	1,22%	2,45%	3,66%	-1,04%	3,18%	<b>9,58%</b>	<b>326%</b>
<b>2022</b>	-1,66%	3,77%	3,30%	4,04%	1,71%	-0,66%	-0,86%	-0,26%	1,00%	2,85%	-3,10%	-0,60%	<b>9,64%</b>	<b>78%</b>
<b>2023</b>	3,70%												<b>3,70%</b>	<b>329%</b>



### 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.