

**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\$ 18.175.472,56  
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

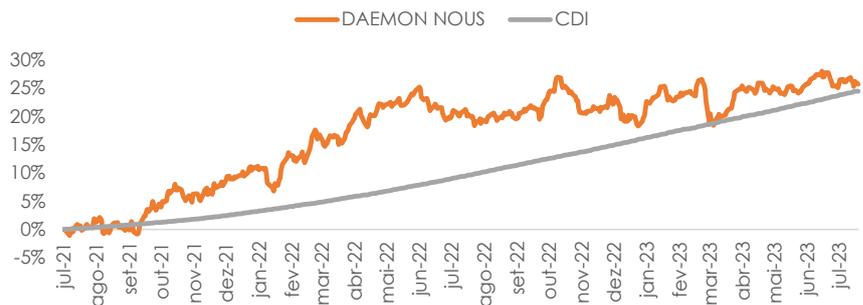
CNPJ: 42.287.467/0001-04

JULHO 2023

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-1,60%	-	6,28%	-4,97
Ano	4,63%	61%	8,34%	-0,66
12 meses	4,72%	35%	8,38%	-1,07
Início	25,70%	105%	8,92%	0,06

## DESEMPENHO

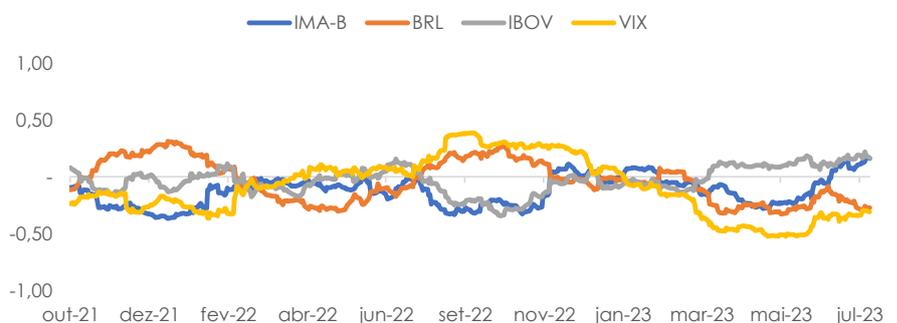
### RENTABILIDADE



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



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



# COMENTÁRIO DO GESTOR



O Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de 1,60% em julho, acumulando 4,63% no ano e 105% do CDI desde o início do fundo. Apesar da alta das bolsas, nossas posições em ações Brasil enfrentaram um cenário desafiador no mês em função do aumento de volatilidade no mercado local. No cenário global, o tom foi dado pelos bancos centrais: o Federal Reserve e o European Central Bank aumentaram suas taxas de juros enquanto o Banco Central do Japão flexibilizou o controle da curva. Esses eventos tiveram impacto nas nossas posições em moedas e juros que até então vinham mostrando uma boa performance no ano. As estratégias de ações, moedas e juros fecharam o mês negativas, -1,15%, -0,96% e -0,48%, respectivamente. Já as posições em índices de ações apresentaram retorno positivo, acumulando 0,26% em julho. As estratégias de volatilidade, commodities industriais e commodities agrícolas também apresentaram retorno positivo, 0,05%, 0,04% e 0,03%, respectivamente.

## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

### EXPOSIÇÃO AO RISCO

### CLASSE DE ATIVO

### RETORNO DO MÊS

VaR

(bps)

36,81

Ações

40,99

Commodities Agrícolas

22,58

Commodities Industriais

16,19

Índices de Ações

18,93

Juros

34,62

Moedas

6,17

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 = 115,49 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%	-1,13%	2,62%	-1,60%						4,63%	61%



### 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.