

## 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\$ 17.999.398,11  
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

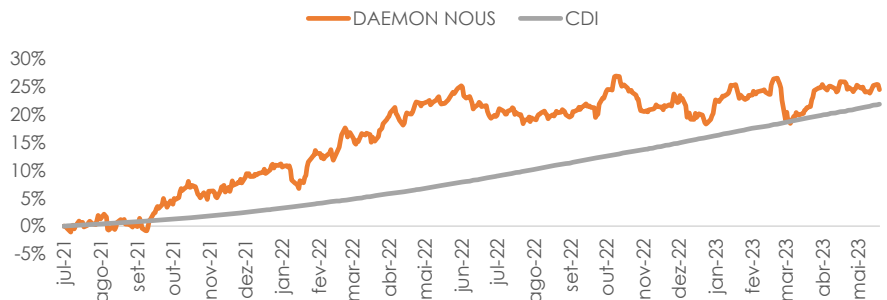
CNPJ: 42.287.467/0001-04

MAIO 2023

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-1,13%	-	5,79%	-4,46
Ano	3,61%	67%	9,13%	-0,50
12 meses	2,03%	15%	8,49%	-1,35
Início	24,48%	112%	9,13%	0,14

## DESEMPENHO

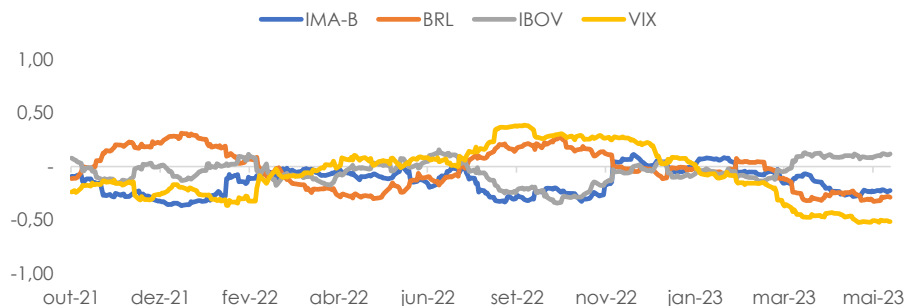
### RENTABILIDADE



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



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

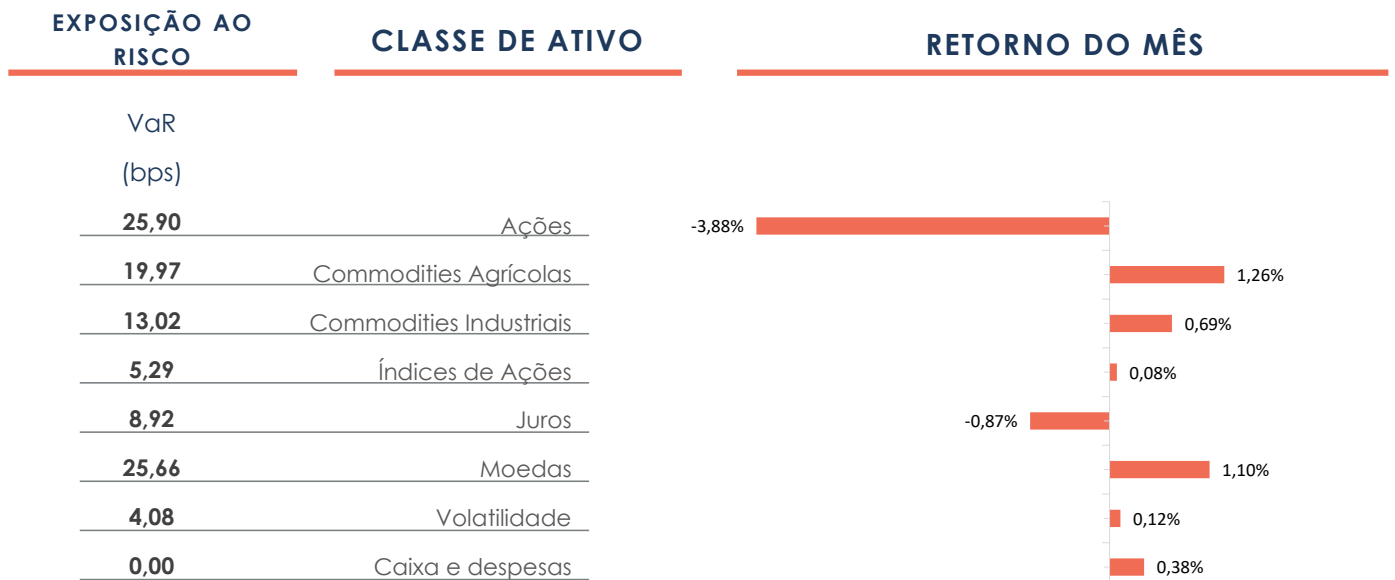
in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br



Em maio, o Nous Global apresentou um retorno negativo de -1,13%, acumulando 3,61% de retorno no ano. O mês foi marcado pela incerteza em relação ao teto da dívida americana. Após uma dura negociação, o congresso americano aumentou o teto poucos dias antes do tesouro ficar em recursos, evitando assim um impensável calote. As bolsas americanas mostraram cautela e rotação entre setores. Destaque para a bolsa brasileira que apresentou uma forte alta mas também uma forte rotação entre setores e fatores. Já tanto as taxas de juros como o dólar subiram em função de um maior prêmio de risco. Commodities agrícolas seguiram com valorização enquanto industriais, em particular energia, desvalorização. Os destaques do mês foram commodities agrícolas, moedas e commodities industriais com retornos de 1,26%, 1,10% e 0,69%, respectivamente. Também fecharam positivas as estratégias de volatilidade, 0,12%, e índice de ações, 0,08%. Os destaques negativos foram as posições em ações e juros que acumularam -3,88% e -0,87% no mês, respectivamente.

## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO



\* 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 = 50,74 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%								3,61%	67%



### 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.