

## 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\$ 17.532.367,26  
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

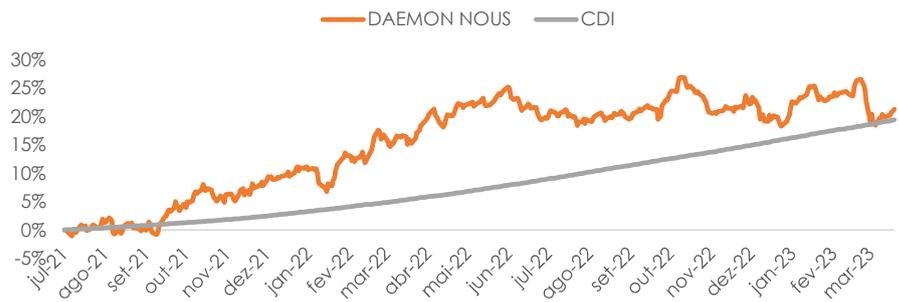
CNPJ: 42.287.467/0001-04

MARÇO 2023

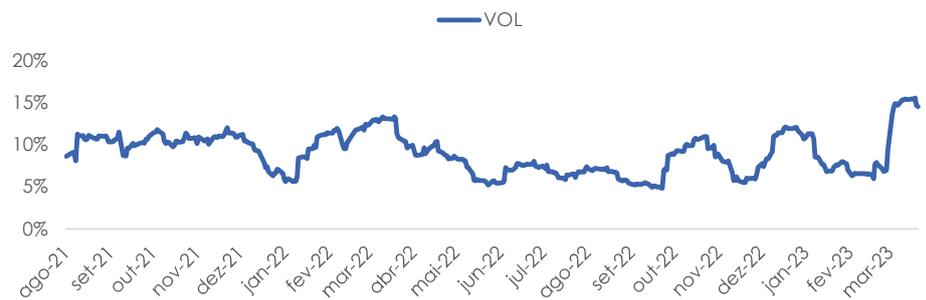
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-1,91%	-	14,53%	-2,25
Ano	0,93%	28%	10,47%	-0,95
12 meses	4,97%	37%	8,65%	-0,96
Início	21,25%	109%	9,34%	0,10

## DESEMPENHO

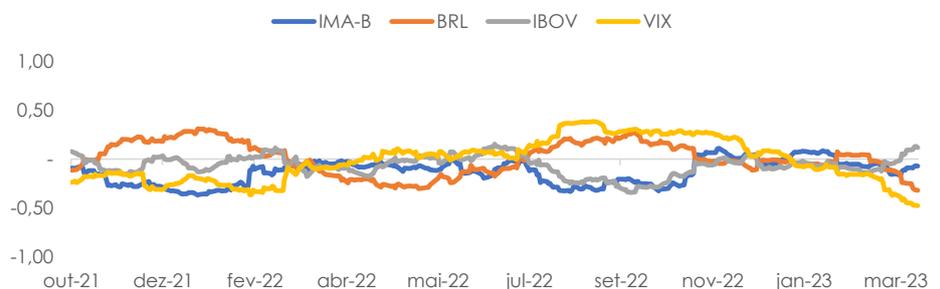
### RENTABILIDADE



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



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

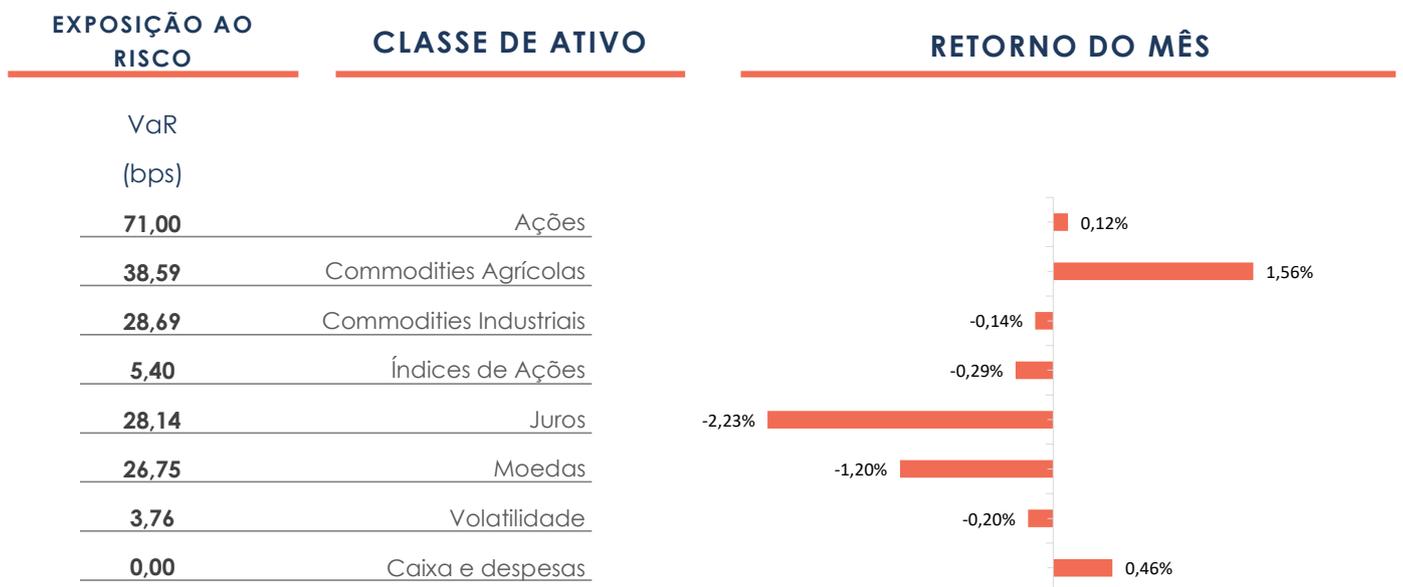
🌐 www.daemoninvestimentos.com.br

# COMENTÁRIO DO GESTOR



O Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de 1,91% em março, acumulando um retorno de 109% do CDI desde o início do fundo. Os mercados globais estiveram à beira do precipício quando dois bancos regionais americanos foram a falência. O movimento nas taxas de juros curto prazo foi tão brutal que só vimos um algo similar no crash da bolsa de 1987. Em questão de dias, a trajetória implícita da política monetária na curva de juros mudou de um ciclo de aumento de juros para um ciclo de cortes, com a taxa de 2 anos fechando 100 pontos base. Essa reprecificação nos juros refletiu em todos os mercados, principalmente moedas e commodities. Já nas bolsas o impacto foi mitigado uma vez que o aumento do prêmio de risco foi compensado por juros mais baixos. O Nous Global foi impactado pelo choque de volatilidade nos mercados, mas seus sistemas prontamente rebalancearam as posições para buscar a meta de risco. Os destaques positivos do mês foram as estratégias de commodities agrícolas e ações, com retornos de 1,56% e 0,12%, respectivamente. Por outro lado, as estratégias de juros foram as que mais sofreram com um retorno de -2,23% no mês, seguidas de moedas, índice de ações, volatilidade e commodities industriais com retornos de -1,20%, -0,29%, -0,20% e -0,14% 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 = 75,41 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%										0,93%	28%



### 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.