

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\$ 10.000
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\$ 17.732.446,42
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

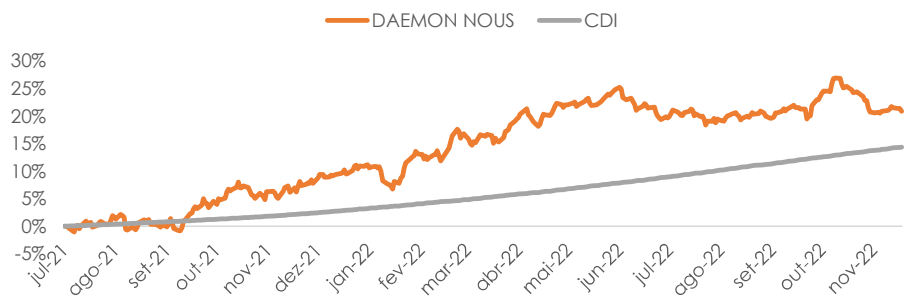
CNPJ: 42.287.467/0001-04

NOVEMBRO 2022

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-3,10%	-	5,81%	-7,98
Ano	10,30%	93%	8,52%	-0,11
12 meses	13,80%	115%	8,43%	0,22
Início	20,86%	145%	8,98%	0,50

DESEMPENHO

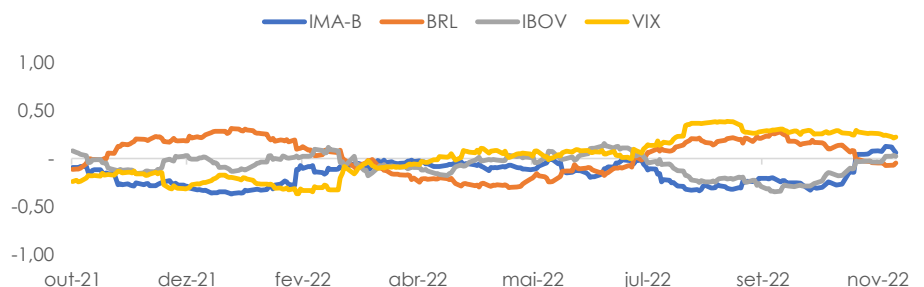
RENTABILIDADE



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 -3,10% em novembro, acumulando 13,80% em 12 meses. Novembro foi um mês de alívio e incerteza nos mercados globais. Os dados de inflação sugerem que a inflação americana já atingiu sua máxima e tende a suavizar nos próximos meses, já os dados de atividade sugerem que a economia ainda está muito aquecida e perto do pleno emprego. O Federal Reserve descartou uma possível pausa ou reversão do aperto monetário em curso nos EUA, mas sinalizou que deve reduzir o ritmo na elevação dos juros. A bolsa americana interrompeu a sequência de quedas dos meses anteriores e mostrou uma recuperação no mês de novembro. Houve um movimento de reversão semelhante nos principais ativos de risco, como juros e moedas. Os destaques positivos do mês foram ações, volatilidade e índice de ações com retornos de 1,47%, 0,29% e 0,17%, respectivamente. Já os destaques negativos foram as posições em moedas, commodities industriais, commodities agrícolas e juros que acumularam -3,28%, -1,17%, -0,82% e -0,29% no mês, respectivamente.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

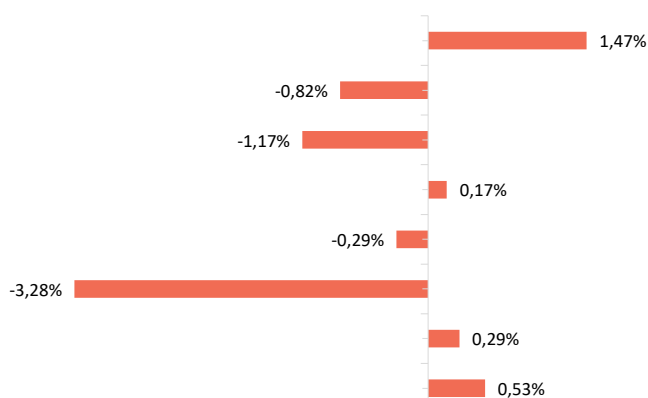
CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

VaR

(bps)

31,48	Ações
27,62	Commodities Agrícolas
27,68	Commodities Industriais
20,05	Índices de Ações
33,24	Juros
18,08	Moedas
7,09	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 = 57,56 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%		10,30%	93%



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.