

## 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\$ 17.792.811,82  
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

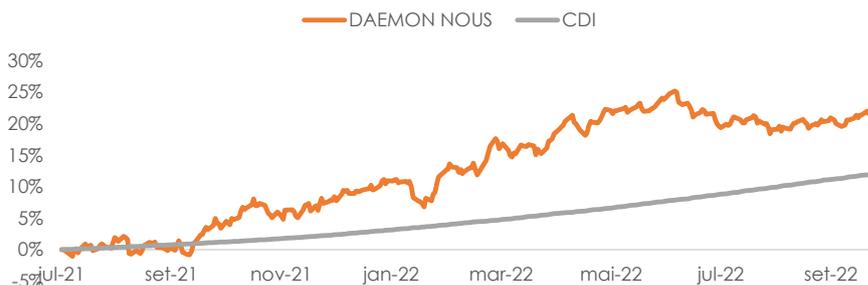
CNPJ: 42,287,467/0001-04

SETEMBRO 2022

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	1,00%	94%	5,02%	-0,18
Ano	10,67%	120%	8,40%	0,29
12 meses	17,14%	157%	8,76%	0,71
Início	21,27%	176%	8,97%	0,81

## DESEMPENHO

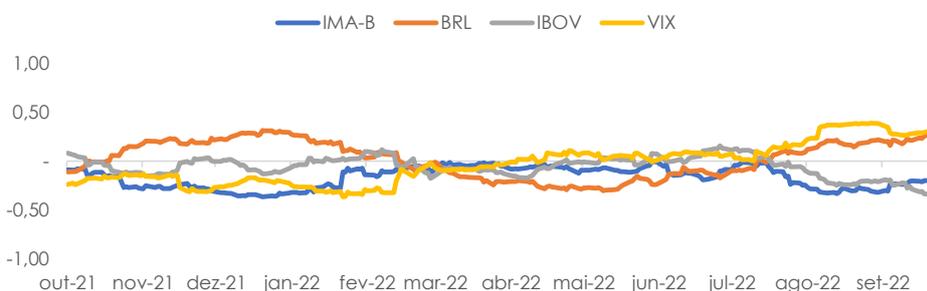
### RENTABILIDADE



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



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



# COMENTÁRIO DO GESTOR



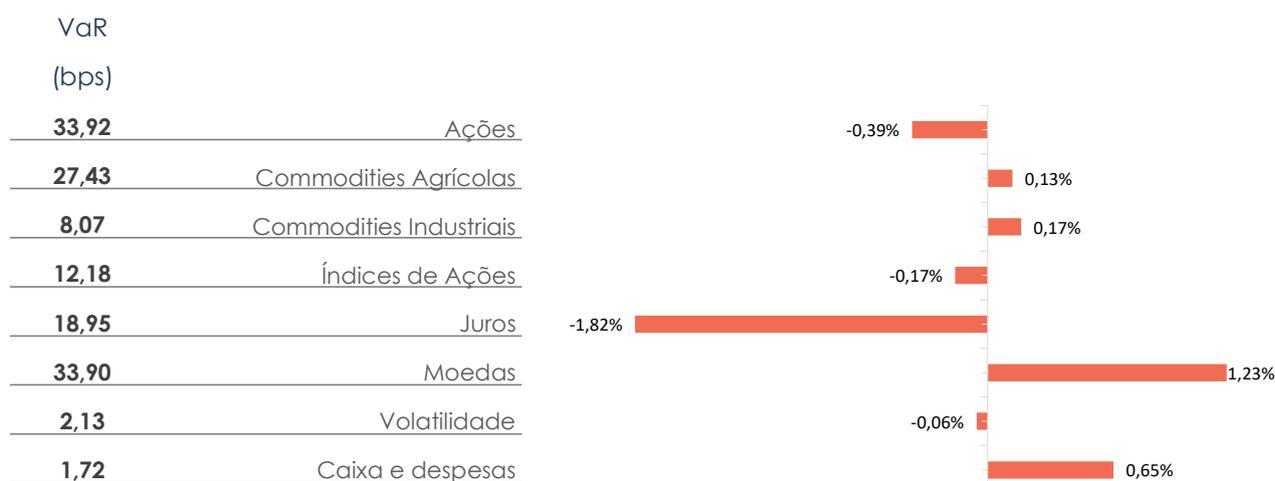
O Daemon Nous Global apresentou um retorno positivo de 1,00% em setembro, acumulando um retorno de 17,141% em 12 meses. Setembro foi um mês muito difícil nos mercados globais. A bolsa americana fechou o mês na mínima do ano. Já as taxas de juros americanas subiram para o maior nível desde a crise de 2008, fazendo com que o dólar se fortalecesse dramaticamente e as commodities seguissem na trajetória de correção. O *Federal Reserve* seguiu com aperto monetário e sinalizou que continuará até conseguir controlar a inflação. Essa dinâmica de mercado, com movimentos rápidos e extremos, foi refletida na performance do Nous. Nossos algoritmos conseguiram capturar os principais movimentos. Os destaques do mês foram moedas, juros e índices de ações com retornos de 2,48%, 1,05% e 0,19%, respectivamente. Já os destaques negativos foram as posições em ações, commodities agrícolas, commodities industriais e volatilidade que acumularam -1,31%, -1,12%, -0,78% e -0,07% no mês, respectivamente.

## RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS



\* 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 = 79,78 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%				10,67%	120%



### 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.