

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: 26/02/2020
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: 2,00% a.a.
Taxa de Performance: 20% 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: 530042
Classificação: Multimercado Livre
Perfil de Risco: Arrojado
Cota: Fechamento
Patrimônio: R\$ 135.303.452,54
Tributação-Alvo: Longo Prazo

Em 04/05/2021 o Daemon Nous Global FIM foi transformado em um **Feeder**, e teve seu regulamento modificado. O desempenho anterior a esta data não leva em conta fatores importantes, como custos com taxas de administração e performance.

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

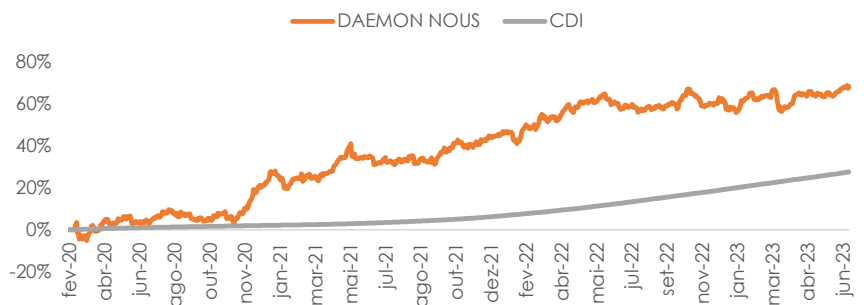
CNPJ: 34.702.572/0001-34

JUNHO 2023

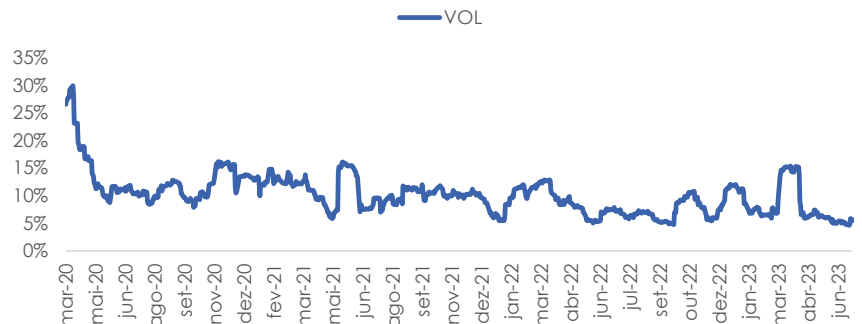
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	2,57%	240%	5,44%	4,04
Ano	6,35%	98%	8,52%	-0,04
12 meses	4,72%	35%	8,29%	-1,07
Início	68,20%	247%	10,98%	0,85

DESEMPENHO

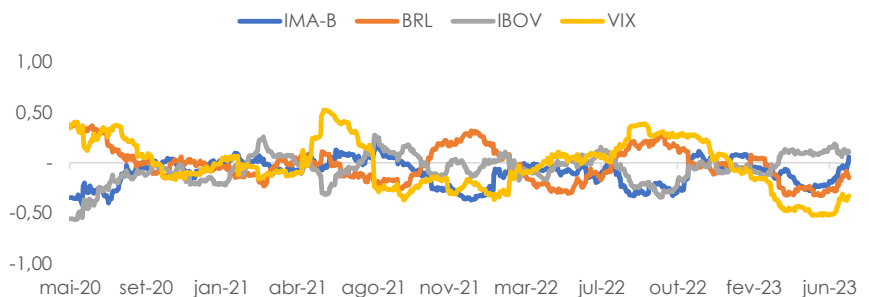
RENTABILIDADE



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 positivo de 2,57% em junho, acumulando 6,35% no ano e 247% do CDI desde o início do fundo. Após meses de indefinição, as bolsas finalmente apresentaram alta ao longo de junho. Apesar da pausa no aperto monetário americano, as taxas de juros voltaram às máximas do ano. Algumas commodities agrícolas também apresentaram forte valorização na primeira metade do mês, mas acabaram revertendo todo o movimento. Já moedas como Yen japonês, Yuan chinês e Peso mexicano consolidaram as fortes tendências que já vinham apresentando. No geral, a economia americana tem apresentado forte resiliência, fazendo com que o cenário de recessão pareça cada vez mais distante. Enquanto isso, segundo o Fed, a convergência da inflação para a meta de 2% não deve ocorrer até 2025, sugerindo que as taxas de juros têm espaço para subir ainda mais. Os destaques do mês foram as estratégias de moedas, ações e juros com retornos de 2,93%, 1,52% e 0,73%, respectivamente. Já os destaques negativos foram as estratégias de commodities agrícolas e commodities industriais que acumularam -2,13% e -1,17% no mês.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

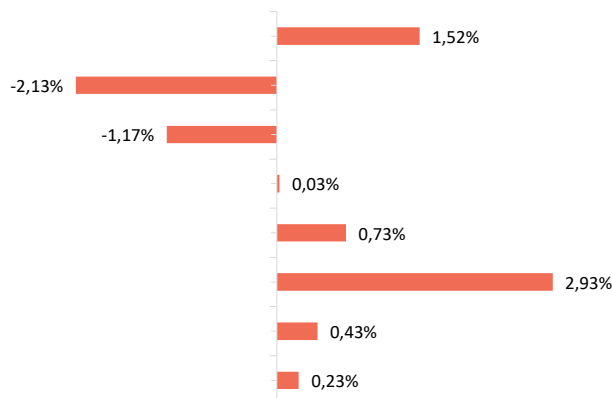
VaR

(bps)

39,57	Ações
34,71	Commodities Agrícolas
24,12	Commodities Industriais
11,76	Índices de Ações
25,10	Juros
32,36	Moedas
6,91	Volatilidade
0,00	Caixa e despesas

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 = 88,99 bps

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI
2020		-0,07%	-0,93%	3,50%	3,74%	-3,37%	6,63%	-1,88%	-2,82%	0,73%	4,83%	10,88%	22,27%	1053%
2021	-2,07%	2,69%	3,05%	5,87%	-0,24%	-0,92%	-0,40%	1,31%	2,41%	3,55%	-0,97%	3,00%	18,37%	418%
2022	-1,76%	3,83%	3,21%	3,87%	1,66%	-0,61%	-0,88%	-0,25%	1,00%	2,81%	-3,08%	-0,60%	9,28%	75%
2023	3,74%	-0,72%	-1,92%	3,77%	-1,08%	2,57%							6,35%	98%



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.