

## 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\$ 139.392.347,62  
 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

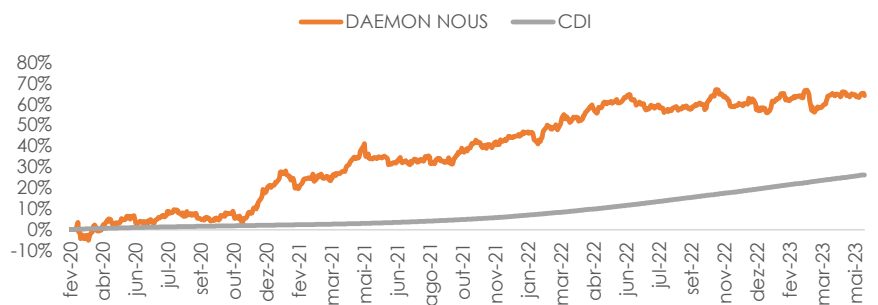
CNPJ: 34.702.572/0001-34

MAIO 2023

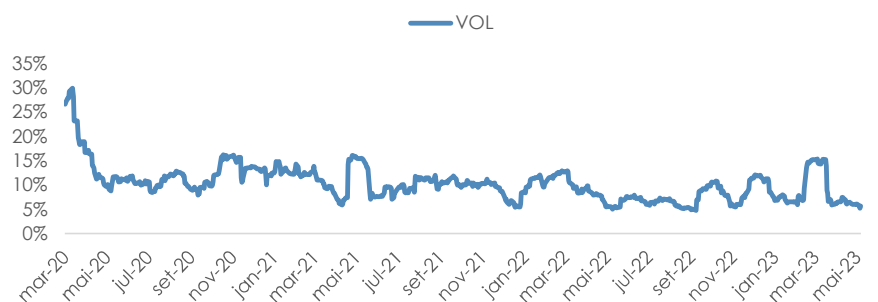
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-1,08%	-	5,66%	-4,49
Ano	3,69%	69%	9,03%	-0,49
12 meses	2,12%	16%	8,40%	-1,36
Início	63,98%	244%	11,09%	0,81

## DESEMPENHO

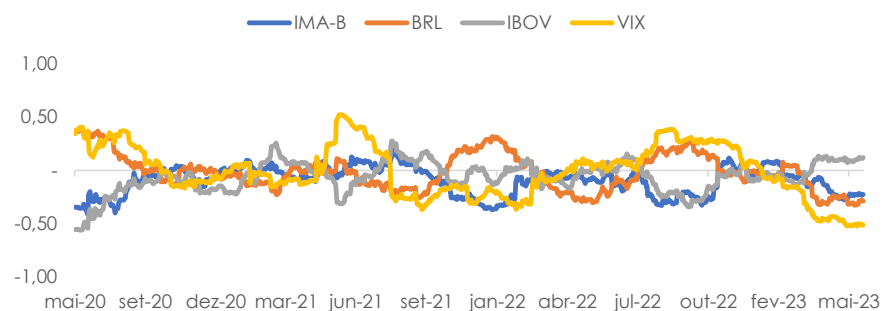
### RENTABILIDADE



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



### CORRELAÇÃO <sup>2</sup>



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br



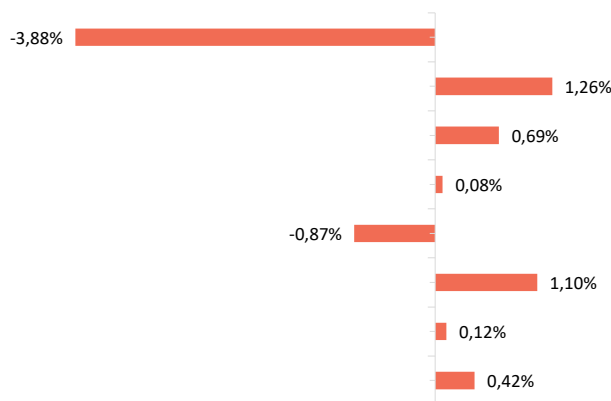
Em maio, o Nous Global apresentou um retorno negativo de -1,08%, acumulando 3,69% de retorno no ano. O mês foi marcado pela incerteza em relação ao teto da dívida americana. Após uma dura negociação, o congresso americano aumentou o teto poucos dias antes do tesouro ficar em recursos, evitando assim 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

### EXPOSIÇÃO AO RISCO

VaR (bps)	CLASSE DE ATIVO
25,90	Ações
19,97	Commodities Agrícolas
13,02	Commodities Industriais
5,29	Índices de Ações
8,92	Juros
25,66	Moedas
4,08	Volatilidade
0,00	Caixa e despesas

### 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 = 50,74 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%								3,69%	69%



### 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.