

Nous Global Feeder I

CNPJ: 42.287.467/0001-04

Agosto/2023

DAEMON
investments

DAEMON NOUS GLOBAL FEEDER I

O fundo Feeder I é o veículo com a nossa estratégia no Brasil para grandes alocadores e Family offices.

FILOSOFIA DE INVESTIMENTO

Somos recompensados por tomar riscos mal precificados. Buscamos retornos absolutos não correlacionados com o mercado.

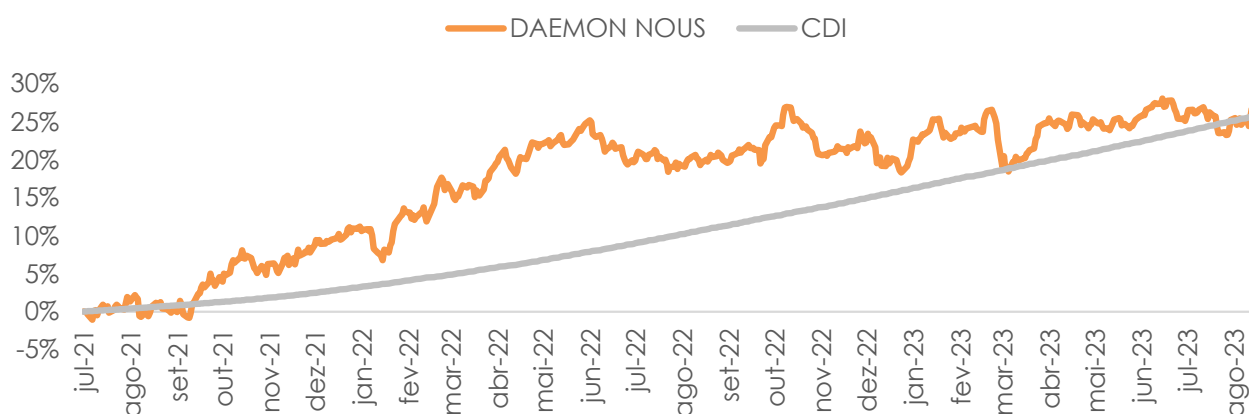
Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global Feeder I apresentou um retorno positivo de 0,83% em agosto, acumulando 5,50% no ano e 103% do CDI desde o início do fundo. O mês foi marcado pela divulgação dos balanços na bolsa brasileira, impactando positivamente nossas posições vendidas em ações. Nos mercados globais, o cenário foi de baixa volatilidade, em função do período de férias no hemisfério norte. A moeda chinesa, por sua vez, refletiu os sinais de uma nova crise imobiliária no país e sofreu forte desvalorização frente ao dólar. Os destaques positivos foram as estratégias de ações, 2,34%. Commodities agrícolas também acumularam retorno positivo no mês, 0,19%. As demais estratégias, índices de ações, commodities industriais, volatilidade e juros, fecharam negativas, -1,16%, -0,68%, -0,17% e -0,14% respectivamente.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 9,02%/8,46%.

O Daemon Nous tem um mandato de volatilidade de 10%.

Rentabilidade Mensal

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM.
2021 Fundo							-0,16%	1,22%	2,45%	3,66%	-1,04%	3,18%	9,58%	9,58%
%CDI							-	288	558	762	-	416	326	326
2022 Fundo	-1,66%	3,77%	3,33%	4,04%	1,71%	-0,66%	-0,86%	-0,26%	1,00%	2,85%	-3,10%	-0,60%	9,64%	20,14%
%CDI	-	503	357	486	166	-	-	-	94	279	-	-	78	128
2023 Fundo	3,70%	-0,78%	-1,91%	3,83%	-1,13%	2,62%	-1,60%	0,83%					5,50%	26,74%
%CDI	329	-	-	417	-	244	-	73					62	103

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR		
(bps)		
44,67	Ações	2,34%
18,20	Commodities Agrícolas	0,19%
14,90	Commodities Industriais	-0,68%
3,88	Índices de Ações	-1,16%
16,59	Juros	-0,14%
27,97	Moedas	0,00%
2,86	Volatilidade	-0,17%
0,00	Caixa e despesas	0,45%

* 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 = 81,86 bps

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\$ 18.326.910,08
 Tributação-Alvo: Longo Prazo

Contato

ri@daemoninvestimentos.com.br
 www.daemoninvestments.com
 Linkedin.com/daemoninvestments
 @daemoninvestments
 youtube.com/daemoninvestments

RATING MORNINGSTAR



(Alternativos – Multiestratégia 10 anos)
 Data de avaliação: 29/03/2022

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.

