

Nous Global Feeder I

CNPJ: 42.287.467/0001-04

Setembro/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.

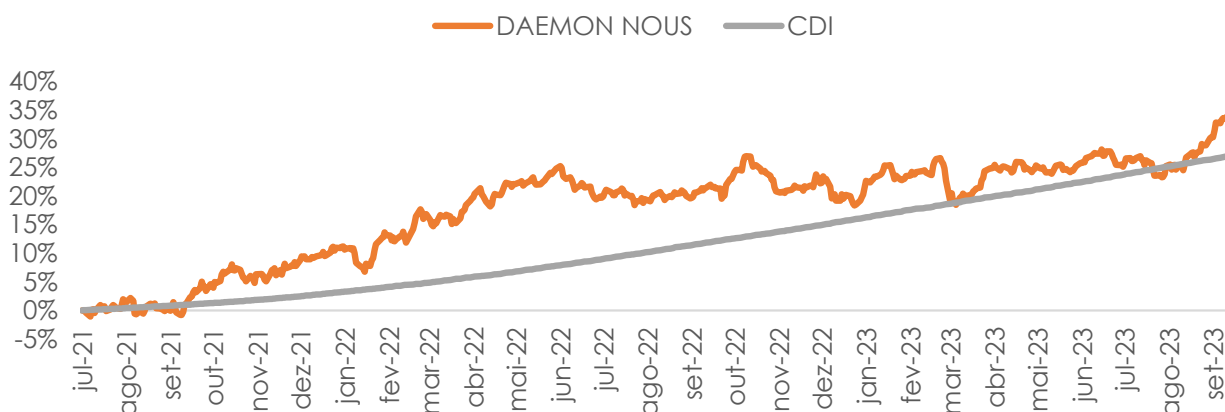
Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global apresentou um retorno positivo de 4,68% em setembro, acumulando 10,43% no ano e 120% do CDI desde o início do fundo. O Federal Reserve pausou o ciclo de aperto monetário mas sinalizou que os juros vão ficar em níveis elevados por bastante tempo. O dólar americano se fortaleceu contra as principais moedas enquanto os juros americanos chegaram a níveis não vistos desde antes da crise de 2008. Já as bolsas caíram praticamente no mundo todo diante do cenário de liquidez mais restrita. Finalmente, o petróleo continuou a tendência de alta chegando a romper as máximas do ano. Os destaques positivos foram as estratégias de ações, juros, commodities industriais e moedas 1,97%, 1,21%, 1,16% e 0,84%, respectivamente. As demais estratégias, commodities agrícolas, índices de ações e volatilidade fecharam negativas, -0,71%, -0,17% e -0,10%, respectivamente.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 8,29%/8,44%.

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%	4,68%				10,43%	32,68%
%CDI	329	-	-	417	-	244	-	73	480				105	120

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	1,97%
18,20	Commodities Agrícolas	-0,71%
14,90	Commodities Industriais	1,16%
3,88	Índices de Ações	-0,17%
16,59	Juros	1,21%
27,97	Moedas	0,84%
2,86	Volatilidade	-0,10%
0,00	Caixa e despesas	0,48%

* 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\$ 19.184.080,59

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.

