

Nous Global Feeder I

CNPJ: 42.287.467/0001-04

Dezembro/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.

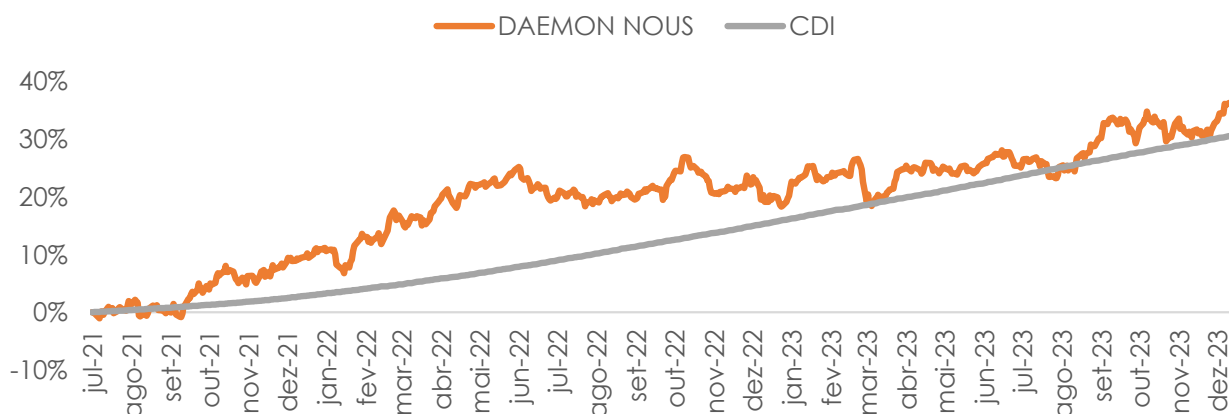
Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global apresentou um retorno positivo de 4,11% em dezembro, fechando o ano em 13,88% e acumulando 120% do CDI desde o início do fundo. Em dezembro, as bolsas globais reagiram positivamente aos dados de inflação americana que confirmaram a continuação do processo de desinflação. O mercado de juros europeu seguiu aquecido diante da expectativa de corte de juros pelos bancos centrais e apresentou novas máximas. A economia chinesa, por outro lado, dá sinais de contração e a bolsa fechou em queda mesmo com os incentivos anunciados pelo governo chinês. Os destaques positivos do Daemon Nous Global foram as estratégias de juros, commodities industriais, ações, índices de ações e volatilidade. Apenas as estratégias de moedas e commodities agrícolas fecharam negativas no mês.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 7,85%/9,04%.

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%	0,02%	-0,97%	4,11%	13,88%	36,81%
%CDI	329	-	-	417	-	244	-	73	480	2	-	458	106	120

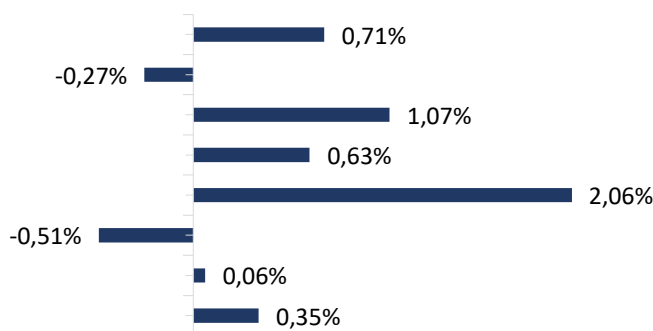
RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

VaR	
(bps)	
25,51	Ações
8,21	Commodities Agrícolas
5,24	Commodities Industriais
7,54	Índices de Ações
15,60	Juros
10,16	Moedas
4,00	Volatilidade
0,00	Caixa e Despesas



* 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 = 42,67 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

Outros

Código ANBIMA: 599506

Classificação: Multimercado Livre

Perfil de Risco: Arrojado

Cota: Fechamento

Patrimônio: R\$ 19.782.522,27

Tributação-Alvo: Longo Prazo

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

Contato

ri@daemoninvestimentos.com.br

www.daemoninvestments.com

Linkedin.com/daemoninvestments

@daemoninvestments

youtube.com/daemoninvestments

RATING MORNINGSTAR



(Alternativos – Multiestatégia 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.

