

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.

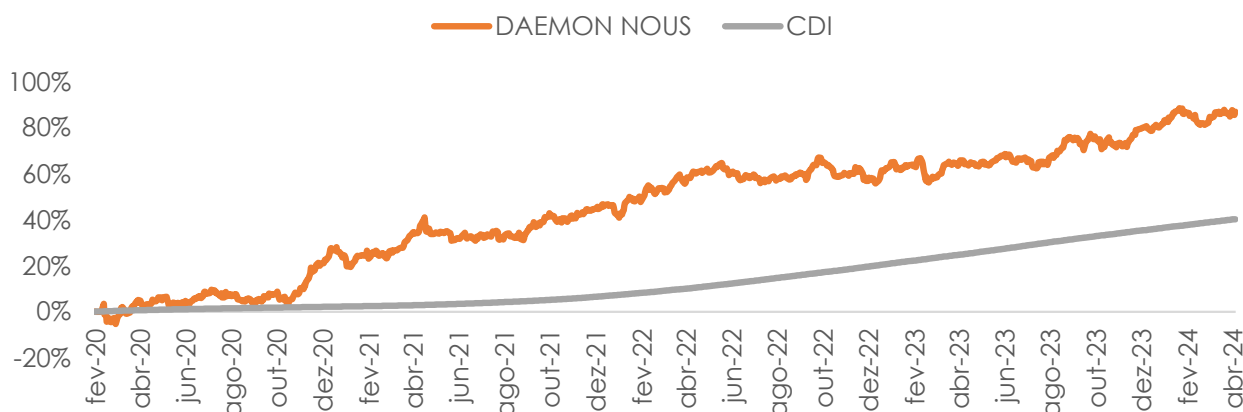
Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global apresentou um retorno positivo 1,48% em abril, acumulando 3,84% no ano. O mês foi marcado pelos dados de inflação americana e a desvalorização do Iene japonês. A resiliência da inflação nos EUA fez com que o mercado acreditasse num Fed mais *hawkish*, derrubando as bolsas e puxando os juros e o dólar. O Iene, por sua vez, sofreu forte desvalorização frente ao dólar, registrando nova mínima histórica, mas a volatilidade no fechamento do mês sugere que o Banco do Japão pode ter atuado para defender a moeda. No mercado doméstico, o Ibovespa foi impactado negativamente pelo cenário internacional de aversão ao risco e encerrou mais um mês no vermelho. Os destaques positivos foram nossas estratégias em moedas, ações e juros. Commodities agrícolas, commodities industriais, índices e volatilidade foram os destaques negativos.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 8,34%/7,39%.

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.
2020														
Fundo		-0,07%	-0,93%	3,50%	3,74%	-3,37%	6,63%	-1,88%	-2,82%	0,73%	4,83%	10,88%	22,27%	22,27%
%CDI		-	-	1228%	1565%	-	3413%	-	-	463%	3231%	6617%	1053%	1053%
2021														
Fundo	-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%	44,73%
%CDI	-	2001%	1540%	2823%	-	-	-	308%	550%	740%	-	393%	418%	677%
2022														
Fundo	-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%	58,15%
%CDI	-	510%	348%	464%	161%	-	-	-	93%	276%	-	-	75%	294%
2023														
Fundo	3,74%	-0,72%	-1,92%	3,77%	-1,08%	2,57%	-1,59%	0,83%	4,62%	0,02%	-0,96%	4,03%	13,77%	79,93%
%CDI	333%	-	-	411%	-	240%	-	72%	474%	2%	-	449%	106%	226%
2024														
Fundo	1,42%	1,46%	-0,56%	1,48%									3,84%	86,84%
%CDI	147%	182%	-	167%									109%	216%

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR		
(bps)		
37,93	Ações	1,65%
5,80	Commodities Agrícolas	-1,00%
6,54	Commodities Industriais	-0,55%
2,67	Índices de Ações	-0,41%
7,43	Juros	0,16%
38,64	Moedas	1,76%
3,56	Volatilidade	-0,11%
0,18	Caixa e Despesas	-0,02%

* 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 = 114,16 bps

INFORMAÇÕES DO PRODUTO

Gerais

Início do Fundo: 26/02/2020
 Administrador: BNY MELLON
 Gestor: DAEMON INVESTIMENTOS
 Custódia: BANCO BNY MELLON
 Controladoria: BANCO BNY MELLON
 Auditor: KPMG

Outros

Código ANBIMA: 530042
 Classificação: Multimercado Livre
 Perfil de Risco: Arrojado
 Cota: Fechamento
 Patrimônio: R\$ 176.663.467,72
 Tributação-Alvo: Longo Prazo

RATING MORNINGSTAR



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

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

Contato

ri@daemoninvestments.com
 www.daemoninvestments.com
 LinkedIn.com/daemoninvestments
 @daemoninvestments
 youtube.com/daemoninvestments

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.

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.

