

Nous Global Feeder I

CNPJ: 42.287.467/0001-04

Setembro/2024

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.

Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de -2,73% em setembro, acumulando -7,61% no ano. O mercado global foi marcado por eventos significativos, incluindo um pacote de estímulos econômicos na China, o ajuste na política monetária norte-americana e o aumento de volatilidade no mercado de petróleo. O governo chinês anunciou um pacote de estímulos econômicos sem precedentes, incluindo cortes nas taxas de juros e injeções de capital em bancos estatais, resultando em uma alta significativa nos mercados chineses. O Federal Reserve, por outro lado, reduziu as taxas de juros em 0,50 ponto percentual em um esforço para controlar a inflação. No Oriente Médio, expectativa de escalada das tensões provocou leve pressão de alta nos preços do petróleo, mas o movimento de alta rapidamente se converteu para queda após a divulgação de que a Arábia Saudita, maior exportador do mundo, pretende ampliar sua participação no mercado. O Daemon Nous Global foi negativamente impactado pelos eventos globais e apenas as estratégias em ações e juros fecharam positivas.

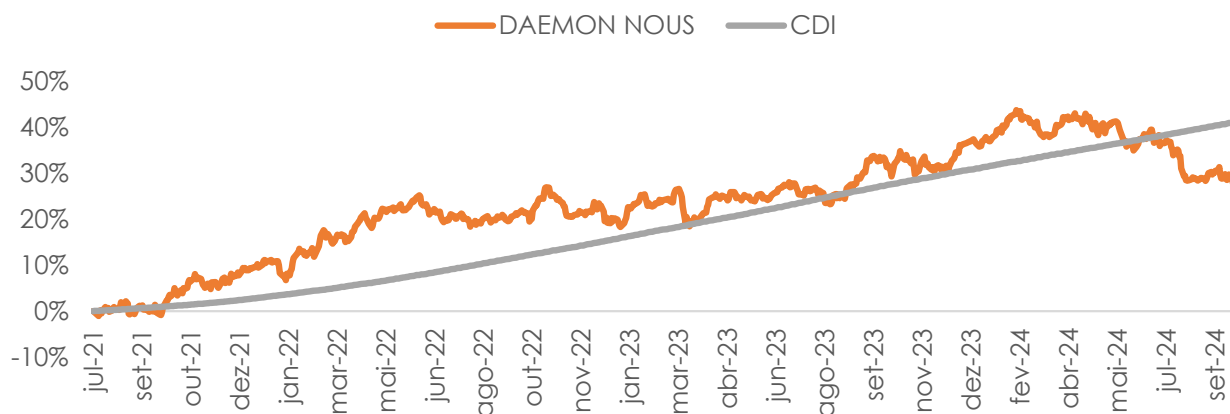
FILOSOFIA DE INVESTIMENTO

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



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 8,56%/9,02%.

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%
2024														
Fundo	1,46%	1,51%	-0,59%	1,55%	-2,00%	-1,02%	-3,19%	-2,71%	-2,73%				-7,61%	26,41%
%CDI	151%	189%	-	174%	-	-	-	-	-				-	64%

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR		
(bps)		
49,35	Ações	0,85%
13,70	Commodities Agrícolas	-0,83%
15,55	Commodities Industriais	-1,91%
2,62	Índices de Ações	-0,79%
6,53	Juros	0,13%
6,00	Moedas	-0,29%
0,05	Volatilidade	-0,02%
1,27	Caixa e Despesas	0,13%

* 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 = 92,42 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\$ 17.348.793,54
 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: 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

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.

