

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.

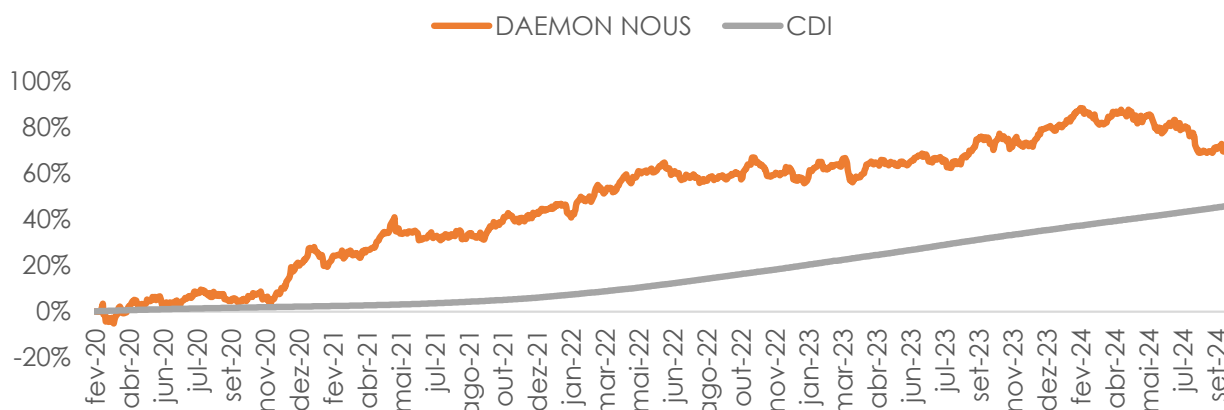
Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global apresentou um retorno negativo de -2,74% em setembro, acumulando -7,57% 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.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 8,51%/8,78%.

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%	-1,97%	-1,00%	-3,10%	-2,69%	-2,74%				-7,57%	66,30%
%CDI	147%	182%	-	167%	-	-	-	-	-				-	143%

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)		
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: 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\$ 162.040.061,16
 Tributação-Alvo: Longo Prazo

RATING MORNINGSTAR



(Alternativos – Multiestratégia 10 anos)
 Data de avaliação: 30/06/2024

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.

