

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.

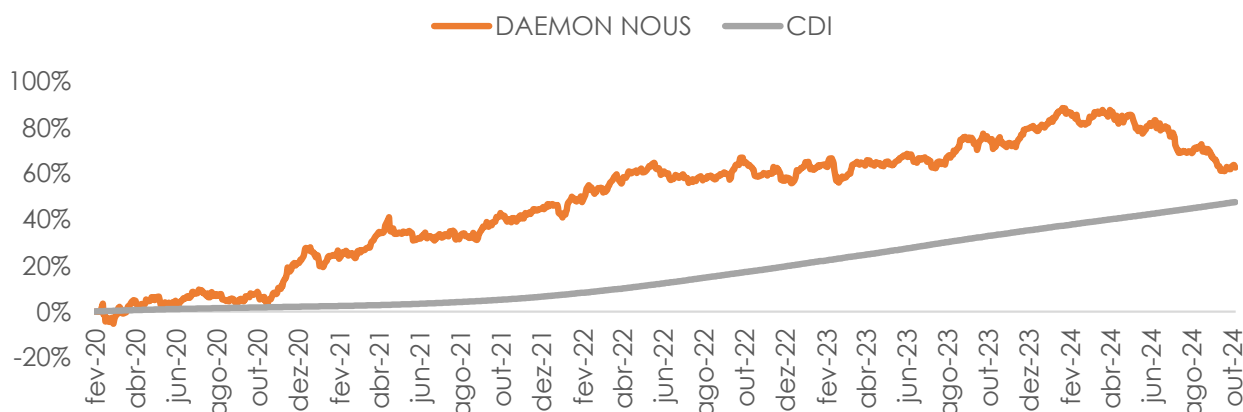
Comentário do Gestor

O Daemon Nous Global registrou retorno negativo de 2,27% em outubro, acumulando -9,67% no ano. No mês, o corte de juros na Europa e novos estímulos na China foram destaques. O Banco Central Europeu reduziu a taxa de depósitos em 25 bps, buscando impulsionar a economia. Na China, após um rali inicial, as bolsas caíram com dados de recuperação abaixo do esperado, mas novas medidas de liquidez sustentaram alta na segunda metade do mês. A volatilidade aumentou com conflitos no Oriente Médio e o cenário eleitoral nos EUA, impactando o mercado de energia e pressionando o desempenho do fundo, principalmente as estratégias de ações e juros.



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 6,83%/8,56%.

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%	-2,27%			-9,67%	62,53%
%CDI	147%	182%	-	167%	-	-	-	-	-	-			-	131%

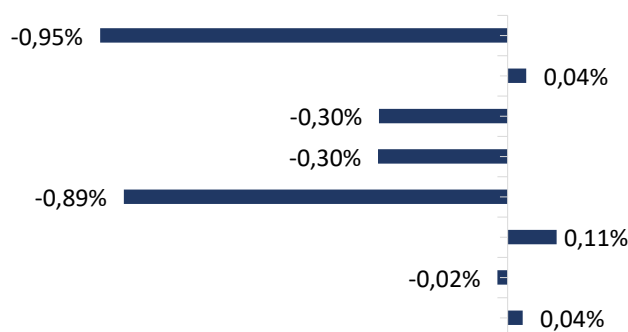
RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

VaR	
(bps)	
28,68	Ações
10,51	Commodities Agrícolas
13,06	Commodities Industriais
7,21	Índices de Ações
2,90	Juros
15,66	Moedas
1,06	Volatilidade
0,32	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 = 79,41 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

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

Outros

Código ANBIMA: 530042
 Classificação: Multimercado Livre
 Perfil de Risco: Arrojado
 Cota: Fechamento
 Patrimônio: R\$ 161.287.963,74
 Tributação-Alvo: Longo Prazo

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.

