

DAEMON NOUS GLOBAL

É um fundo multimercado diversificado e balanceado que explora fatores de risco no Brasil e no exterior, de maneira sistemática.

Comentário do Gestor

Janeiro foi marcado pelo início de um novo ciclo político nos EUA e por decisões sobre juros globais. Apesar do tom protecionista adotado durante sua campanha, Donald Trump surpreendeu os mercados ao evitar a imposição imediata de tarifas nos primeiros dias de mandato, o que inicialmente impulsionou as bolsas e enfraqueceu o dólar. No entanto, uma semana após a posse, o presidente americano começou a dar os primeiros sinais de medidas tarifárias, impondo restrições à importação de metais como cobre e alumínio, além de ameaçar taxar todas as exportações colombianas caso o país decidisse barrar a entrada de voos com deportados vindos dos EUA. No cenário macroeconômico, o Banco do Japão anunciou um aumento em sua taxa de juros devido à aceleração da inflação no país, levando os juros ao maior nível desde 2008. Já o Fed manteve a taxa de juros dos EUA inalterada, citando riscos inflacionários persistentes e interrompendo uma sequência de três cortes consecutivos. No Brasil, o Copom elevou a taxa de juros em 1,0 p.p., conforme esperado pelo mercado. O Daemon Nous Global teve um desempenho negativo, acumulando -2,61% no mês e -11,23% nos últimos 12 meses.

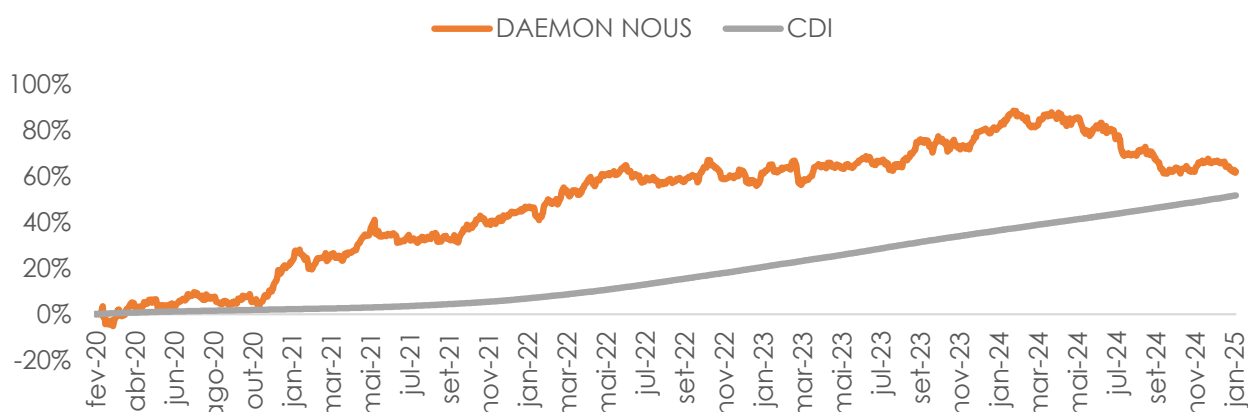
FILOSOFIA DE INVESTIMENTO

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



Acesse o conteúdo completo!

Rentabilidade acumulada



Volatilidade mês/ano: 5,97%/5,97%.

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% | 0,82% | 1,50% | -7,56% | 66,33% |
| %CDI | 147% | 182% | - | 167% | - | - | - | - | - | - | 104% | 162% | - | 132% |
| 2025 | | | | | | | | | | | | | | |
| Fundo | -2,61% | | | | | | | | | | | | -2,61% | 61,99% |
| %CDI | - | | | | | | | | | | | | - | 120% |

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) | | |
| 34,93 | Ações | -0,58% |
| 3,16 | Commodities Agrícolas | -0,67% |
| 2,98 | Commodities Industriais | -0,74% |
| 2,19 | Índices de Ações | -0,08% |
| 9,27 | Juros | -0,10% |
| 12,11 | Moedas | -0,87% |
| 0,64 | Volatilidade | 0,02% |
| 0,42 | Caixa e Despesas | 0,40% |

* 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 = 65,72 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\$ 115.842.011,30
 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.

