

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.

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\$ 64.969.702,58
Tributação-Alvo: Longo Prazo

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.

NOTAS

1: A volatilidade é o desvio padrão simples dos retornos por períodos rolados de 21 dias úteis

2: Correlação dos retornos do Nous Global com outros ativos por períodos rolados de 63 dias úteis

✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
--	---------	-------	-----	--------

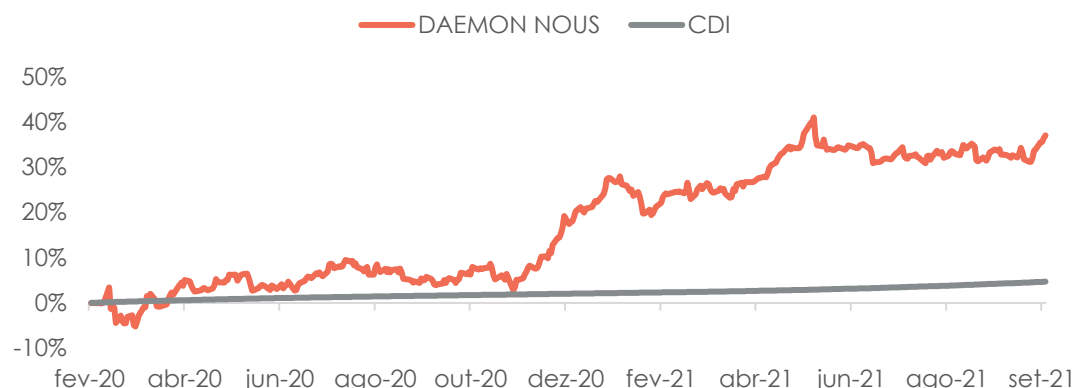
Mês	2,41%	542%	10,41%	2,65
-----	-------	------	--------	------

12 meses	31,20%	1041%	11,92%	2,38
----------	--------	-------	--------	------

Início	37,01%	791%	13,03%	1,46
--------	--------	------	--------	------

DESEMPENHO

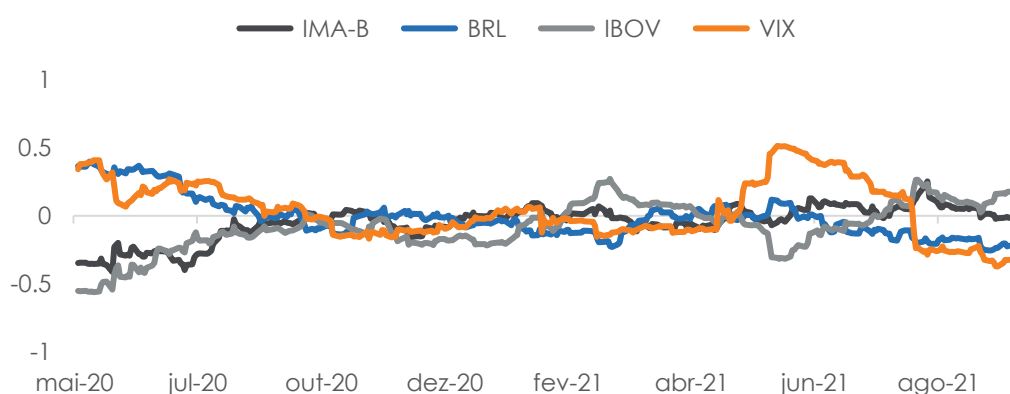
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²





COMENTÁRIO DO GESTOR

Em setembro o Nous Global apresentou um retorno positivo de 2,41%. Assim, o retorno do fundo em 12 meses chega a 31,20%, isto é, 1041% do CDI, com Índice Sharpe anualizado de 2,38. A incerteza ainda é grande nos mercados globais e o ambiente ainda segue desafiador, principalmente para as bolsas e juros globais. Devido a choques de oferta, os mercados de energia apresentaram uma forte alta em setembro. Conseqüentemente, o destaque positivo do mês foram as commodities industriais, em particular, óleo e gás. Mesmo com queda na bolsa brasileira, as estratégias de bolsa Long/Short também apresentaram um bom resultado em setembro. Já juros, índices de ações, commodities agrícolas, volatilidade e moedas tiveram uma contribuição negativa no período. Por fim, a volatilidade do fundo em setembro ficou aderente à meta e consistente com as diretrizes estabelecidas na política de risco do fundo.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO*		CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
GROSS	NET		
89%	7%	Ações	2.23%
29%	16%	Commodities agrícolas	-0.41%
14%	7%	Commodities industriais	2.89%
9%	8%	Índices de ações	-0.68%
1460%	115%	Juros	-0.98%
81%	-27%	Moedas	-0.18%
1%	-1%	Volatilidade	-0.19%
63%	63%	Caixa, despesas e outros	-0.26%

* As exposições são calculadas com base nos *notionals* das posições e não são uma boa representação do risco alocado nas classes de ativo.

HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI
2020		-0,07%	-0,93%	3,50%	3,74%	-3,37%	6,36%	-1,88%	-2,82%	0,73%	4,83%	10,88%	22,27%	1053%
2021	-2,07%	2,69%	3,05%	5,87%	-0,24%	-0,92%	-0,40%	1,31%	2,41%				12,06%	480%



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.