

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\$ 69.519.866,16
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

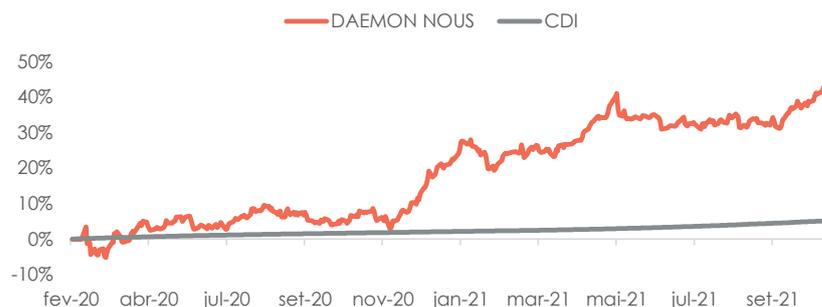
CNPJ: 34.702.572/0001-34

OUTUBRO 2021

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	3,55%	750%	9,91%	4,95
12 meses	33,81%	1015%	11,79%	2,60
Início	41,88%	809%	12,90%	1,57

DESEMPENHO

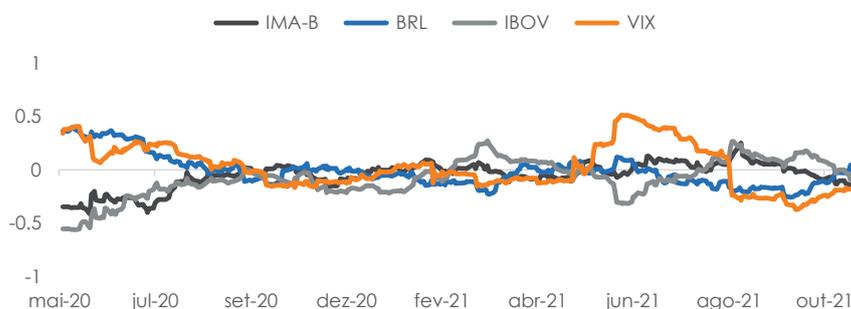
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

🌐 www.daemoninvestimentos.com.br



COMENTÁRIO DO GESTOR

Em outubro, o Nous Global apresentou um retorno positivo de 3,55%. Com isso, a cota do fundo chega a novas máximas com retorno de 33,81% em 12 meses, isto é, 1015% do CDI, e índice Sharpe anualizado de 2,60. O destaque positivo foram as estratégias Long/Short em ações Brasil. A bolsa brasileira apresentou muita volatilidade e grandes perdas, mas nossos algoritmos que são desenhados para ter exposição direcional neutra em ações (beta zero) conseguiram navegar bem nesse ambiente e capturar um retorno de 3,40% no mês. Ainda contribuíram positivamente em outubro as estratégias em moedas, 0,61%, commodities agrícolas, 0,39%, índices de ações globais, 0,25% e volatilidade, 0,16%. Já commodities industriais e juros internacionais apresentaram contribuição negativa de -0,16% e -0,17% respectivamente. Enquanto o mercado brasileiro tem seguido sua própria dinâmica, o contexto internacional ainda apresenta seus desafios em função da política monetária americana. Mesmo com a bolsa americana atingindo novas máximas históricas no final de outubro, o início do mês foi desafiador nos mercados globais, principalmente para juros e moedas. De fato, foi um mês bastante volátil nos mercados globais, mas, ainda assim, a volatilidade do Nous Global manteve-se aderente à meta de 10% ao longo de todo mês, fechando em 9,91% em outubro.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO*		CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
GROSS	NET		
93%	2%	Ações	3.40%
33%	12%	Commodities agrícolas	0.39%
10%	8%	Commodities industriais	-0.16%
24%	22%	Índices de ações	0.25%
979%	110%	Juros	-0.17%
86%	-28%	Moedas	0.61%
2%	-2%	Volatilidade	0.16%
70%	65%	Caixa, despesas e outros	-0.92%

* 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%	3,55%			16,04%	535%



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.