

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\$ 71.857.248,36
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
--	---------	-------	-----	--------

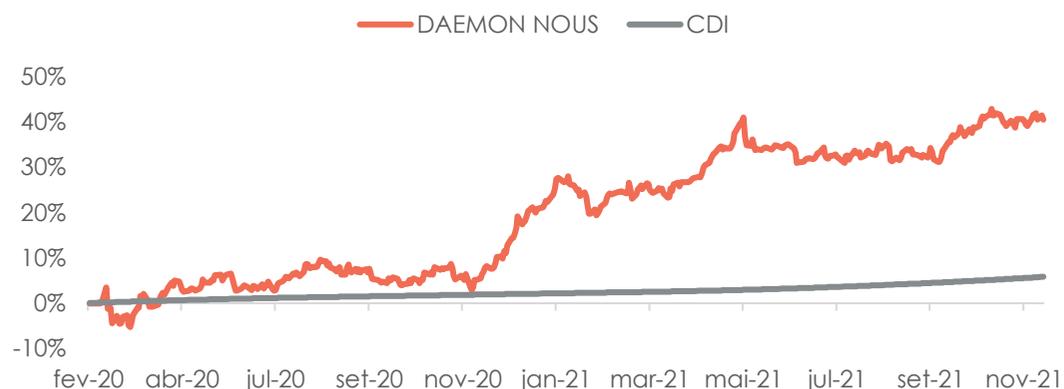
Mês	-0,97%	-	10,46%	-1,83
-----	--------	---	--------	-------

12 meses	27,49%	727%	11,41%	2,09
----------	--------	------	--------	------

Início	40,51%	699%	12,81%	1,42
--------	--------	------	--------	------

DESEMPENHO

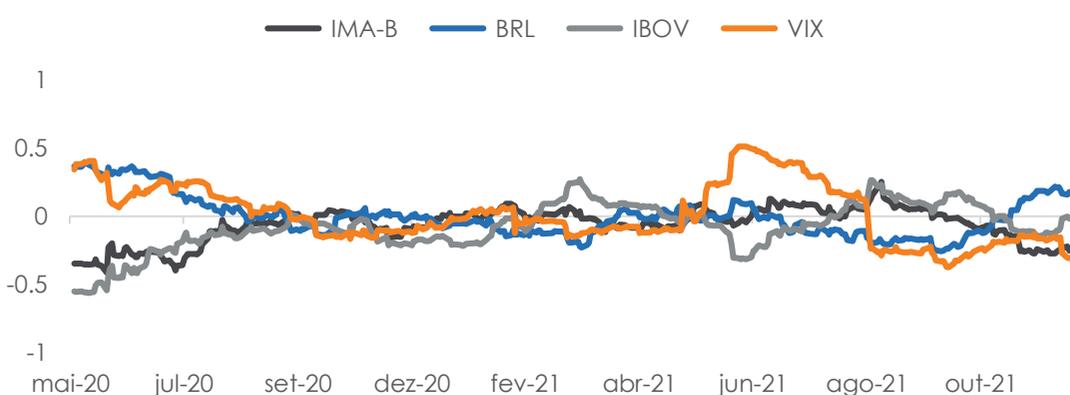
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²





COMENTÁRIO DO GESTOR

Em novembro, o Nous Global apresentou um retorno negativo de -0,97%. Assim, o retorno do fundo em 12 meses chega a 27,49%, isto é, 727% do CDI, com índice Sharpe anualizado de 2,09. O que parecia um mês benigno se mostrou bastante desafiador nos últimos dias. Notícias negativas em relação à variante Omicron abalaram os mercados globais no meio do feriado americano de Ação de Graças, um período de liquidez restrita. Quando os mercados ensaiaram uma recuperação, o presidente do banco central americano anunciou uma mudança de tom em relação à inflação. Segundo Powell, o termo “transitório” não deveria mais ser usado para descrever a inflação americana. Powell também sinalizou que poderia acelerar o ritmo de retirada dos estímulos monetários. Esses dois eventos tiveram um impacto considerável na performance do Nous Global, em particular, nas estratégias de commodities, índices de ações e volatilidade, respectivamente as piores perdas em novembro. Por outro lado, as estratégias de bolsa Long/Short mostraram um bom resultado no mês em função da queda na bolsa brasileira. Mesmo com o considerável aumento da volatilidade nos mercado nos últimos dias do mês, a volatilidade do fundo em novembro ficou aderente à meta.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO*		CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
GROSS	NET		
100%	12%	Ações	1.49%
30%	27%	Commodities agrícolas	-0.87%
3%	-1%	Commodities industriais	-0.86%
15%	14%	Índices de ações	-0.37%
947%	-678%	Juros	-0.02%
88%	-55%	Moedas	-0.09%
2%	-2%	Volatilidade	-0.54%
63%	57%	Caixa, despesas e outros	0.30%

* 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%	-0,97%		14,92%	414%



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.