

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\$ 89.300.353,39
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

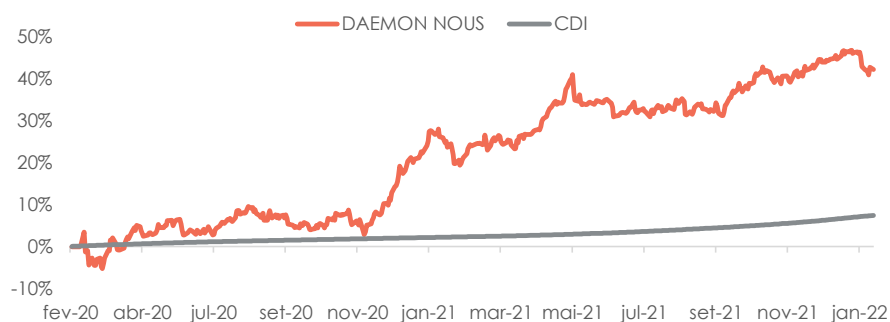
CNPJ: 34.702.572/0001-34

JANEIRO 2022

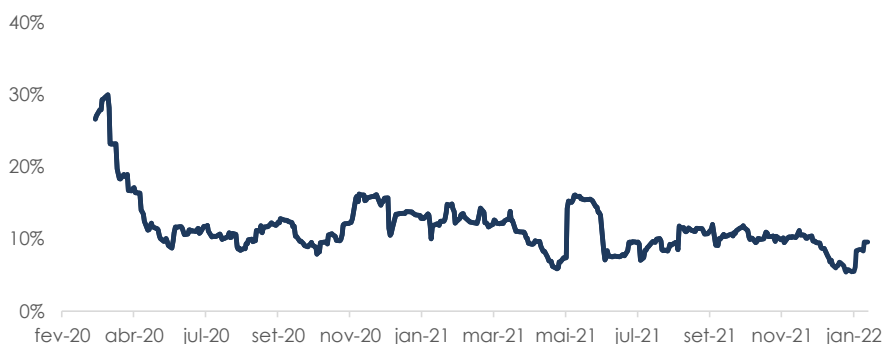
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-1,76%	-	9,59%	-2,96
12 meses	18,74%	375%	10,30%	1,33
Início	42,17%	571%	12,47%	1,31

DESEMPENHO

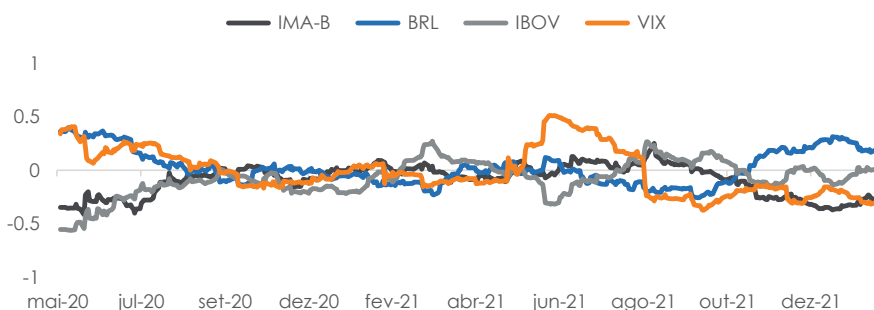
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²





COMENTÁRIO DO GESTOR

Em janeiro, o Nous Global apresentou um retorno negativo de -1,76%. Assim, o retorno do fundo em 12 meses chega a 18,74%, isto é, 395% do CDI, com índice Sharpe anualizado de 1,33. O novo ano começou agitado, ainda na primeira semana de 2022 as bolsas internacionais começaram uma queda que se estenderia até a última semana do mês. O vilão da vez foi o Federal Reserve que sinalizou que estava desconfortável com a inflação e que faria o ajuste na política monetária, tanto encerrando o programa de compra de ativos como aumentando as taxas de juros, o *liftoff*. Powell foi calibrando o discurso ao longo do mês, cada fala com um tom mais *hawkish*. Como não poderia ser diferente, o Fed *hawkish* gerou um reprecificação generalizada nos mercados globais, principalmente quando a sinalização ficou ainda mais clara na reunião do FOMC de janeiro. O Nous Global sentiu o impacto: com exceção de commodities industriais (+0,61%) e ações (+0,24%), todas as classes de ativos apresentaram perdas em janeiro. Mesmo com o considerável aumento da volatilidade nos mercados ao longo do mês, a volatilidade do fundo ficou aderente à meta.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO*		CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
GROSS	NET		
87%	16%	Ações	0.24%
31%	27%	Commodities agrícolas	-1.31%
17%	15%	Commodities industriais	0.61%
7%	-5%	Índices de ações	-0.68%
1336%	738%	Juros	-0.25%
104%	-67%	Moedas	-0.38%
1%	-1%	Volatilidade	-0.30%
55%	50%	Caixa, despesas e outros	0.33%

* 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%	3,00%	18,37%	418%
2022	-1,76%												-1,76%	-



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.