

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
Controladora: 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\$ 97.335.021,59
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

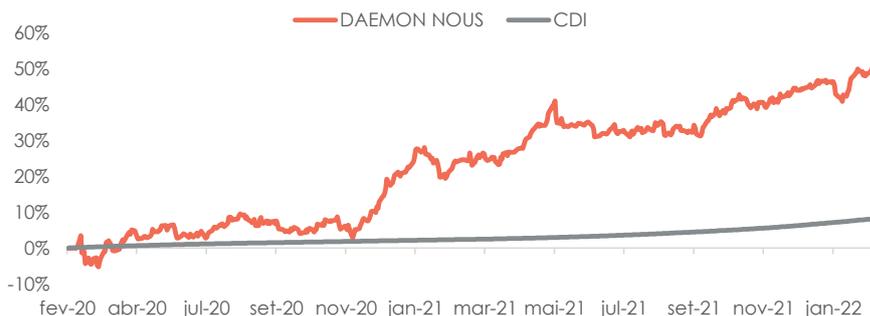
CNPJ: 34.702.572/0001-34

FEVEREIRO 2022

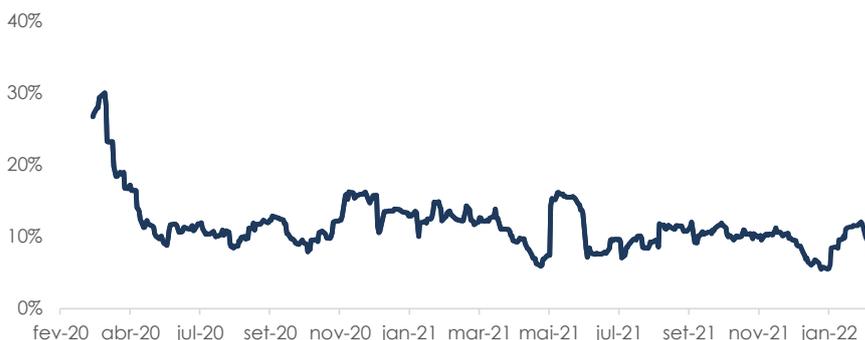
| | RETORNO | % CDI | VOL | SHARPE |
|----------|---------|-------|--------|--------|
| Mês | 3,83% | 510% | 10,41% | 5,20 |
| Ano | 2,00% | 134% | 10,63% | 0,33 |
| 12 meses | 19,06% | 338% | 10,08% | 1,33 |
| Início | 47,61% | 582% | 12,38% | 1,41 |

DESEMPENHO

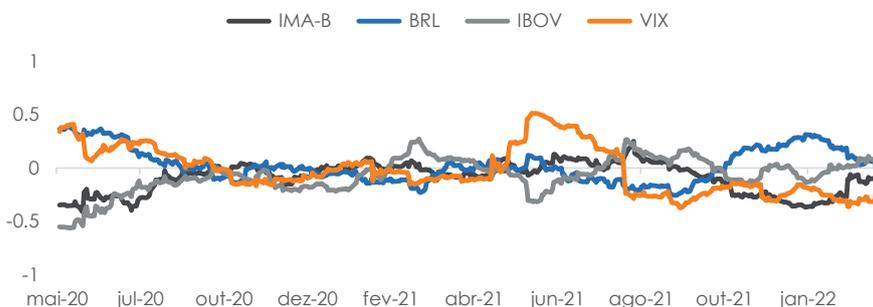
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²





COMENTÁRIO DO GESTOR

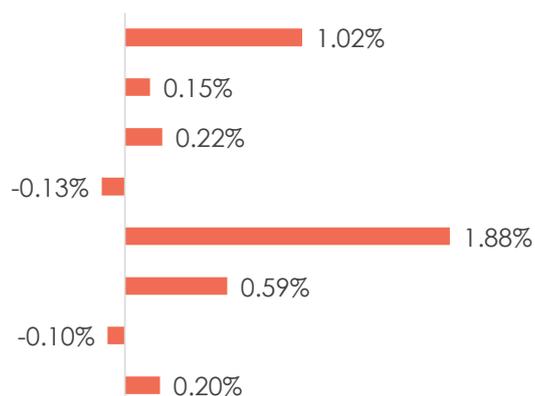
Em fevereiro, o Nous Global apresentou um retorno positivo de 3,83%, acumulando 19,06% de retorno em 12 meses, isto é, 338% do CDI, com índice Sharpe de 1,33. Fevereiro foi marcado pela agressividade dos principais bancos centrais e, no apagar das luzes, pela Rússia. O Federal Reserve e o ECB, que mostraram um extremo desconforto com a inflação, sinalizaram que a normalização da política monetária será ainda mais rápida e intensa do que o mercado havia precificado, levando a um forte ajuste nas curvas de juros. Não só as taxas de juros aumentaram ao longo da curva, como as taxas curtas aumentaram mais do que as longas. Esse movimento de juros foi acompanhado por um aumento generalizado nos preços das commodities, em particular agrícolas e energia. Já na última semana do mês, a Rússia declarou guerra à Ucrânia, gerando muita volatilidade e busca por segurança, o que corrigiu boa parte do movimento nos juros e nas commodities. Os destaques do mês foram juros, ações e moedas com retornos de 1,88%, 1,02% e 0,59%, respectivamente. Também fecharam positivas as estratégias de commodities industriais, 0,22%, e agrícolas, 0,15%. Os destaques negativos foram as posições em índice de ações e volatilidade que acumularam -0,13% e -0,10% no mês, respectivamente.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

| EXPOSIÇÃO AO RISCO | CLASSE DE ATIVO |
|--------------------|--------------------------|
| VaR (bps) | |
| 43.38 | Ações |
| 54.62 | Commodities agrícolas |
| 34.77 | Commodities industriais |
| 6.88 | Índices de ações |
| 14.53 | Juros |
| 20.81 | Moedas |
| 4.87 | Volatilidade |
| 1.33 | Caixa, despesas e outros |

RETORNO DO MÊS



* 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 = 107.14 bps

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% | 3,83% | | | | | | | | | | | 2,00% | 134% |



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.