

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\$ 132.292.300,89
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

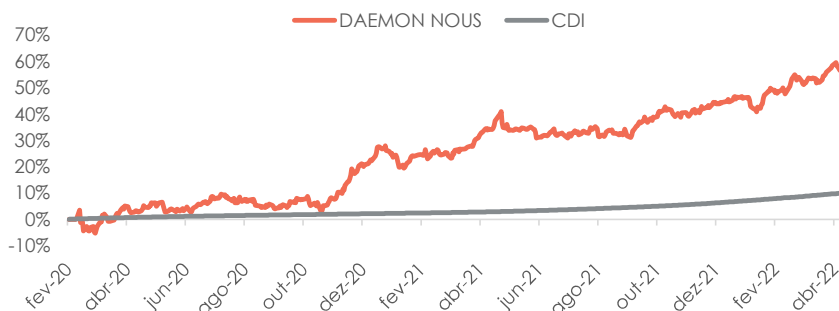
CNPJ: 34.702.572/0001-34

ABRIL 2022

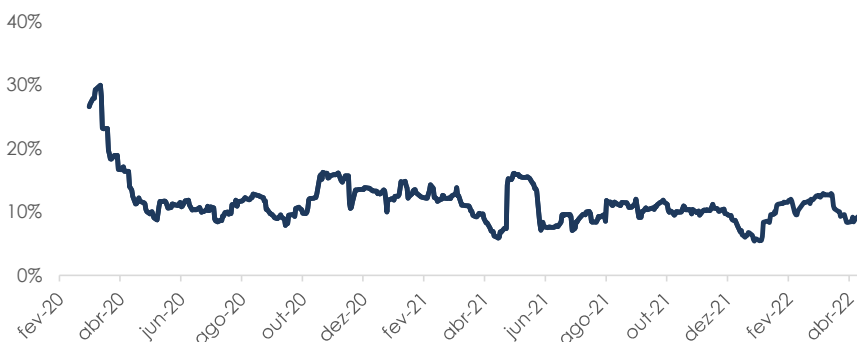
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	3,87%	464%	8,76%	5,08
Ano	9,35%	285%	10,65%	2,02
12 meses	17,78%	251%	10,35%	1,03
Início	58,25%	577%	12,27%	1,56

DESEMPENHO

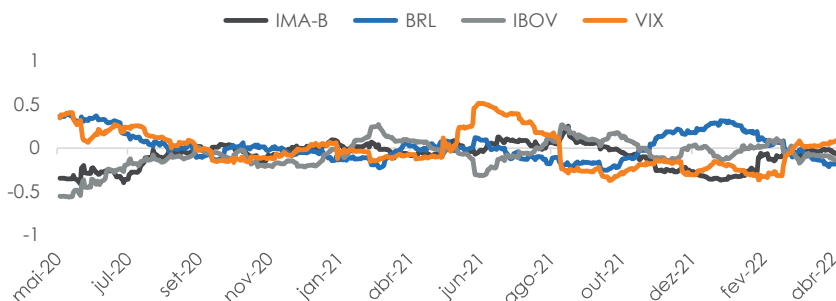
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²





COMENTÁRIO DO GESTOR

Em abril, o Daemon Nous Global gerou um retorno positivo de 3,87%, acumulando um retorno de 9,35% no ano, isto é, 285% do CDI, com índice Sharpe de 2,02. Abril foi um mês de bastante volatilidade nos mercados globais, a bolsa americana teve seu pior mês desde o início da pandemia em 2020. A inflação tem mostrado resiliência em várias partes do globo. Diante desse cenário, os membros do *Federal Reserve* sinalizaram que será necessário subir a taxa básica de juros ainda mais rápido que o implícito na curva de juros, fazendo com que a taxa do *Treasury* de 10 anos atingisse o maior nível desde 2019. De fato, os modelos tradicionais de política monetária projetam que taxa básica deveria estar acima do que o implícito na curva, logo esse movimento nos juros ainda pode ter espaço para continuar. Apesar do ambiente turbulento, as estratégias do Daemon Nous Global tendem a navegar bem um ambiente de inflação e tendência, seja positiva ou negativa, nos mercados. Os destaques do mês foram as estratégias em ações, juros, commodities agrícolas e commodities industriais com retornos de 1,99%, 1,44%, 1,37% e 0,31%, respectivamente. Os destaques negativos foram as posições em moedas, índices de ações e volatilidade que acumularam -0,43%, -0,27% e -0,10%, no mês.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

VaR

(bps)

46.96

Ações

37.93

Commodities agrícolas

17.97

Commodities industriais

2.57

Índices de ações

29.34

Juros

19.06

Moedas

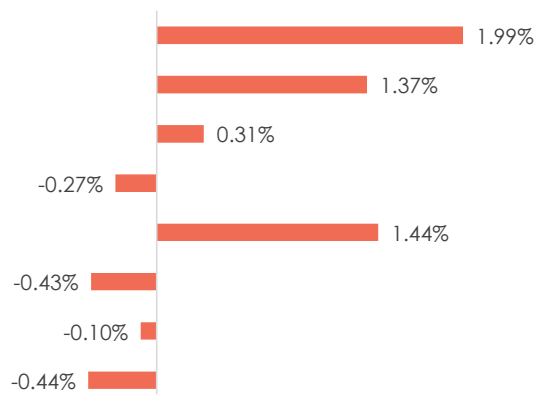
1.66

Volatilidade

2.94

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 = 103.26 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%	3,21%	3,87%									9,35%	285%



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.