

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\$ 150.029.026,18
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

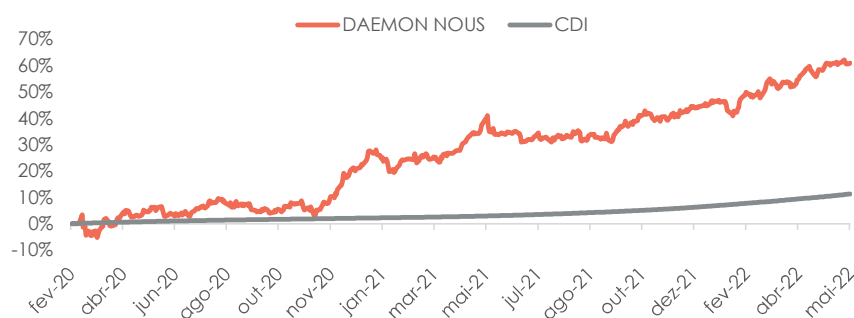
CNPJ: 34.702.572/0001-34

MAIO 2022

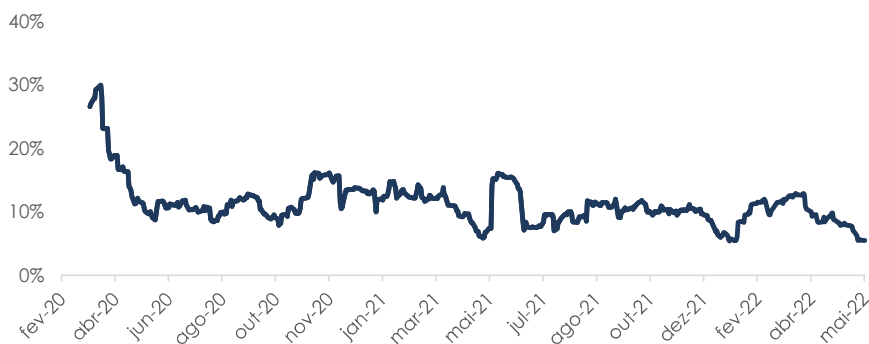
	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	1,66%	161%	5,50%	1,78
Ano	11,16%	257%	10,40%	1,79
12 meses	20,21%	256%	9,51%	1,30
Início	60,87%	542%	12,07%	1,55

DESEMPENHO

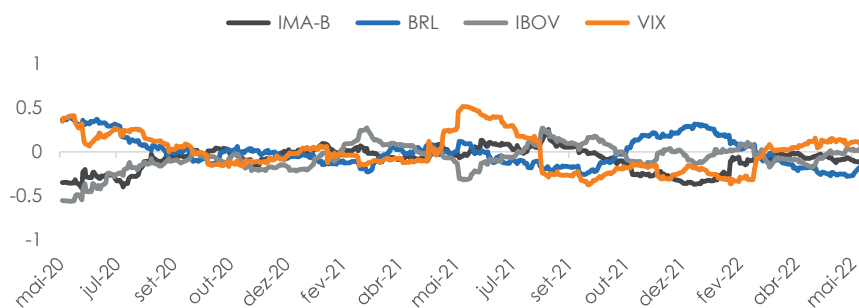
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²





COMENTÁRIO DO GESTOR

O Daemon Nous Global gerou um retorno de 1.66% no mês de maio, acumulando um retorno de 11,16% no ano, isto é, 257% do CDI, com índice Sharpe de 1,79. Com um início de mês de alta volatilidade, as bolsas americanas apresentaram novas mínimas no ano e as taxas de juros novas máximas. O Federal Reserve americano continua determinado que segurar a inflação. Chair Powell avisou que não hesitará em continuar subindo os juros até a inflação baixar, o que fez com que a palavra "recessão" voltasse ao noticiário. De fato, a resiliência da inflação faz como que o cenário de um "soft landing" seja cada vez mais difícil. Felizmente, o Daemon Nous Global foi desenhado para navegar bem nos extremos do mercado. Como temos observado nos últimos meses, assim como vemos em nossas simulações históricas, o fundo tende a performar bem num cenário de alta volatilidade e recessão. Os destaques do mês foram as estratégias em ações, commodities industriais e juros com retornos de 1,38%, 0,23% e 0,16%, respectivamente. Os destaques negativos foram as posições em moedas e índices de ações que acumularam perdas de -0,26% e -0,23%, no mês. Com a turbulência nos mercados o nosso sistema de controle de risco reduziu a alavancagem, fazendo com que a volatilidade realizada no mês ficasse abaixo do mandato de 10%.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO

EXPOSIÇÃO AO RISCO

CLASSE DE ATIVO

RETORNO DO MÊS

EXPOSIÇÃO AO RISCO	CLASSE DE ATIVO	RETORNO DO MÊS
VaR		
(bps)		
58.74	Ações	1.38%
27.26	Commodities agrícolas	0.01%
11.26	Commodities industriais	0.23%
4.53	Índices de ações	-0.23%
17.92	Juros	0.16%
10.92	Moedas	-0.26%
1.05	Volatilidade	-0.02%
0.53	Caixa, despesas e outros	0.39%

* 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 = 84.67 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%	1,66%								11,16%	257%



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.