

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\$ 159,960,483.31
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

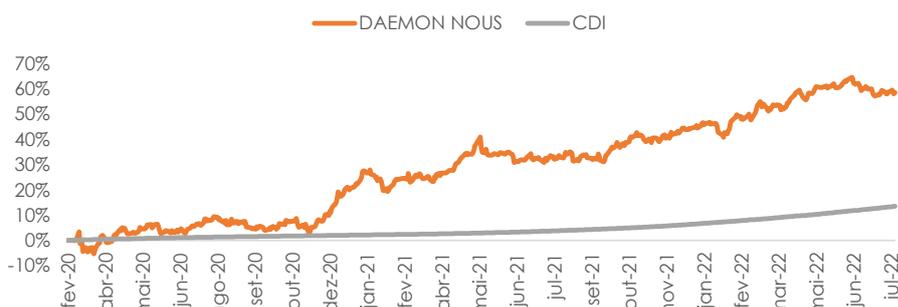
CNPJ: 34.702.572/0001-34

JULHO 2022

	RETORNO	% CDI	VOL	SHARPE
Mês	-0.88%	-	6.38%	-3.63
Ano	9.51%	146%	8.87%	0.63
12 meses	18.89%	201%	9.31%	1.02
Início	58.49%	433%	11.81%	1.32

DESEMPENHO

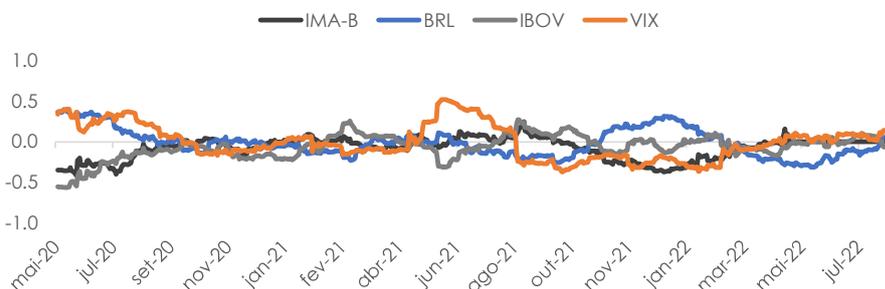
RENTABILIDADE



VOLATILIDADE ¹



CORRELAÇÃO ²



✉ contato@daemoninvestimentos.com.br

☎ 11-3074-4300

in Daemon Investimentos

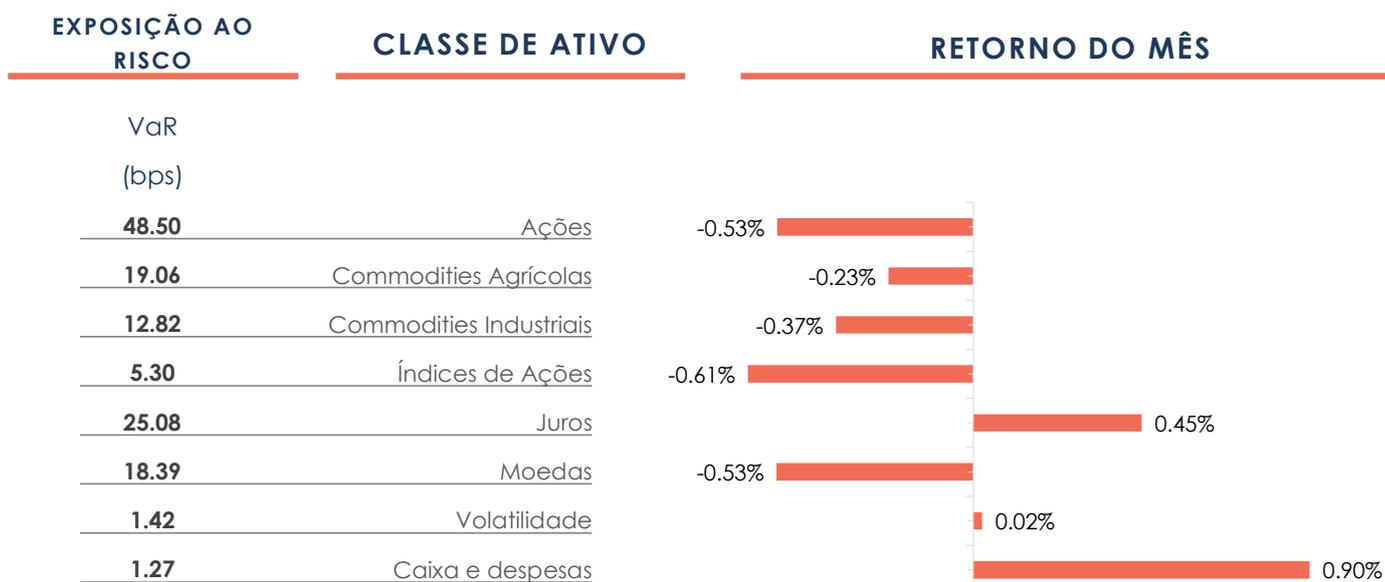
🌐 www.daemoninvestimentos.com.br

COMENTÁRIO DO GESTOR



O Daemon Nous Global teve um resultado negativo no mês de julho (-0,88%), acumulando um retorno de 18,89% em 12 meses, isto é, 201% do CDI, com índice Sharpe de 1,02. Em julho os mercados globais deram sequência aos movimentos iniciados em meados de junho. Bolsas seguiram em recuperação, taxas de juros longas caindo e commodities corrigindo. Esses movimentos sugerem que o mercado continua aumentando o peso no cenário de recessão, ao contrário dos dados da economia americana. Mesmo com PIB negativo nos dois últimos trimestres, as condições financeiras, os dados de atividade, o mercado de trabalho e a inflação ainda são compatíveis com uma economia aquecida. A incerteza, e, conseqüentemente, a volatilidade nos mercados, deve persistir. O Daemon Nous Global não trabalha com nenhum cenário específico e seus algoritmos se adaptam as condições de mercado. Quando há grande incerteza e rápidas mudanças nessas condições, é esperado que os algoritmos se adaptem mais lentamente, mas tal adaptação ocorre continuamente. O único destaque positivo do mês foram as estratégias em juros globais com retorno de 0,45%. Os destaques negativos foram as posições em índices ações, ações, moedas, e commodities industriais e agrícolas.

RETORNO POR CLASSES DE ATIVO



* 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 = 74.42 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%	6.63%	-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%	-0.61%	-0.88%						9.51%	146%



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.