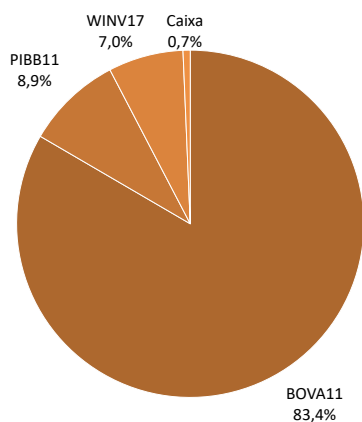


## Estratégia de Investimento

O fundo Nest Ibovespa FIA busca atingir um retorno ligeiramente superior ao Ibovespa mantendo uma alta correlação com o índice. O fundo destina-se a investidores que querem ter um retorno próximo ao do índice mas com uma rentabilidade melhor que a de fundos passivos. O fundo deve manter seu patrimônio aplicado em carteira de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no mercado financeiro e de capitais, de acordo com seu Regulamento e que sejam admitidos pela Resolução CMN n.º 3.922/10 do Conselho Monetário Nacional e suas alterações posteriores que possam vir a ocorrer.



## Composição da Carteira



## Performance Histórica

Mês	Fundo	Ibovespa
3M	18,34%	18,12%
6M	14,29%	14,33%
Desde Início	14,14%	14,59%

### Estatísticas

Exposição líquida média	99,18%
Correlação com o Ibovespa	0,99
Tracking error	2,13%
Volatilidade anualizada	19,27%
Maior Drawdown	-12,70%
Meses positivos	6
Meses negativos	2
Meses acima do Ibovespa	4
Meses abaixo do Ibovespa	4

## Atribuição Setorial

	Exposição	Contribuição
Índices/ETF	99,33%	4,66%
Outros		
Caixa/Custos	0,67%	-0,19%

## Maiores Exposições<sup>1</sup>

Banco Itau PN (ITUB4)	11,00%
Bradesco PN N1 (BBDC4)	8,32%
Vale R Doce ON (VALE3)	7,82%
Ambev (ABEV3)	7,29%
Petrobras PN (PETR4)	5,19%
B3 SA Bolsa Brasil Balcão (BVMF3)	3,91%
Petrobras ON (PETR3)	3,54%
Banco do Brasil ON (BBAS3)	3,47%
Itausa - Investimentos Itaú (ITSA4)	3,43%
Brasil Foods (BRFS3)	2,99%
Ultrapar ON N1 (UGPA3)	2,52%
Kroton (KROT3)	2,29%
Lojas Renner ON Nm (LREN3)	2,02%
Cielo (CIEL3)	1,97%
Telefonica Brasil SA (VIVT4)	1,71%

<sup>1</sup> calculada através da decomposição dos Índices e ETFs em seus constituintes e posterior agrupamento

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
<b>2017</b>		<b>2,58%</b>	<b>-2,64%</b>	<b>0,73%</b>	<b>-4,47%</b>	<b>0,36%</b>	<b>5,16%</b>	<b>7,73%</b>	<b>4,46%</b>				<b>14,14%</b>
Ibovespa		2,82%	-2,52%	0,64%	-4,12%	0,30%	4,80%	7,46%	4,88%				14,59%

## Informações Operacionais

Objetivo do Fundo	Superar o Ibovespa no longo prazo	Taxa de Administração	2,00% a.a. (max. 2,50%)
Público Alvo	Investidores em Geral e Investidores enquadrados na res. 3922/10	Taxa de Performance	20% do que exceder o Ibovespa (semestral), com marca d'agua
Categoria ANBIMA	Ações Índice Ativo	Aplicação Mínima	R\$ 10.000,00
Data de Início	01 de fevereiro de 2017	Movimentação Mínima	R\$ 5.000,00
Bloomberg Ticker	NSTIBOV BZ <Equity>	Resgates	D+1, pagamento em D+3 após conversão
Gestor	Nest Asset Management	Administrador/Distribuidor	BNY Mellon Serviços Financeiros
Custodiante	BNY Mellon Banco S.A.	SAC	sac@bnymellon.com.br ou no telefone (21) 3219-2998
Auditoria	KPMG	Ouvidoria	ouvidoria@bnymellon.com.br ou no telefone 0800 7253219