

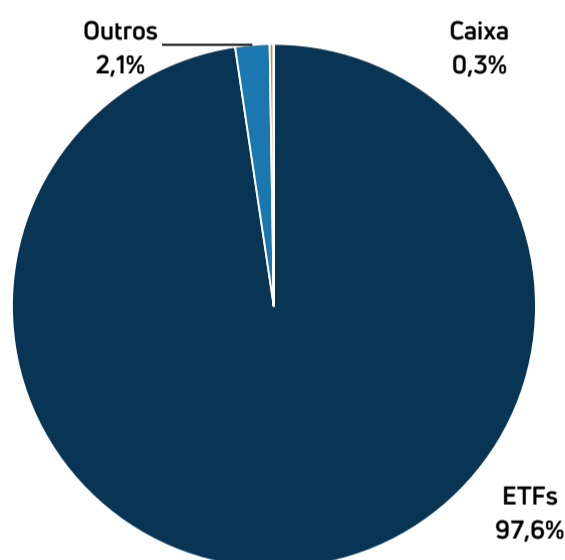


## ESTRATÉGIA DE INVESTIMENTO

O FUNDO busca atingir seus objetivos através de operações de aluguel e arbitragem entre ativos que representem o índice Bovespa ou tenham uma alta correlação com o índice. Adicionalmente o fundo pode eventualmente comprar opções ou ações de empresas com potencial de retorno superior ao do índice dentro de um limite pré-estabelecido. O fundo respeita os limites e vedações estabelecidos na resolução CMN 3.922 e alterações posteriores.



## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA



## PERFORMANCE HISTÓRICA

|                           | FUNDO         | Ibovespa      | BOVA11        |
|---------------------------|---------------|---------------|---------------|
| <b>Mês</b>                | <b>-6,70%</b> | <b>-6,57%</b> | <b>-6,65%</b> |
| 12M                       | 16,77%        | 17,31%        | 16,96%        |
| 24M                       | 6,88%         | 5,95%         | 5,43%         |
| 36M                       | 40,42%        | 39,87%        | 39,00%        |
| YTD                       | -7,22%        | -6,75%        | -7,12%        |
| Desde Início              | 72,09%        | 71,17%        | 69,81%        |
| <b>Estatísticas</b>       |               |               |               |
| Exposição líquida média   | 99,82%        |               |               |
| Correlação com o Ibovespa | 0,98          |               |               |
| Tracking error            | 3,73%         |               |               |
| Volatilidade anualizada   | 26,67%        | 26,49%        | 26,65%        |
| Maior Drawdown            | -46,33%       | -46,82%       | -47,03%       |
| Meses positivos           | 34            | 35            | 34            |
| Meses negativos           | 22            | 21            | 22            |
| Meses acima do Ibovespa   | 26            |               |               |
| Meses abaixo do Ibovespa  | 30            |               |               |

## ATRIBUIÇÃO SETORIAL

|              | Exposição | Contribuição |
|--------------|-----------|--------------|
| Índices/ETF  | 99,73%    | -6,50%       |
| Outros       |           |              |
| Caixa/Custos | 0,27%     | -0,20%       |

## MAIORES EXPOSIÇÕES<sup>1</sup>

|                                     |        |
|-------------------------------------|--------|
| Vale R Doce ON (VALE3)              | 13,73% |
| Banco Itau PN (ITUB4)               | 5,79%  |
| B3 S.A. ON (B3SA3)                  | 5,15%  |
| Petrobras PN (PETR4)                | 4,93%  |
| Bradesco PN N1 (BBDC4)              | 4,65%  |
| Petrobras ON (PETR3)                | 3,58%  |
| Magazine Luiza (MGLU3)              | 3,22%  |
| Ambev (ABEV3)                       | 2,95%  |
| Weg Sa (WEGE3)                      | 2,84%  |
| Suzano Papel-ord (SUZB3)            | 2,65%  |
| (GNDI3)                             | 2,59%  |
| Itausa - Investimentos Itaú (ITSA4) | 2,13%  |
| Jbs ON Nm (JBSS3)                   | 1,98%  |
| Natura Cosmetico (NTCO3)            | 1,91%  |
| Banco do Brasil ON (BBAS3)          | 1,76%  |

<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>2021</b> | <b>-3,62%</b> | <b>-4,48%</b> | <b>6,16%</b>   | <b>2,13%</b>  | <b>5,96%</b>   | <b>0,39%</b>  | <b>-3,86%</b> | <b>-2,60%</b> | <b>-6,70%</b> |               |               |               | <b>-7,22%</b> |
| Ibovespa    | -3,32%        | -4,37%        | 6,00%          | 1,94%         | 6,16%          | 0,46%         | -3,94%        | -2,48%        | -6,57%        |               |               |               | -6,75%        |
| <b>2020</b> | <b>-2,10%</b> | <b>-7,67%</b> | <b>-30,18%</b> | <b>11,66%</b> | <b>8,96%</b>   | <b>8,92%</b>  | <b>8,40%</b>  | <b>-3,55%</b> | <b>-4,83%</b> | <b>-0,29%</b> | <b>15,70%</b> | <b>9,10%</b>  | <b>4,74%</b>  |
| Ibovespa    | -1,63%        | -8,43%        | -29,90%        | 10,25%        | 8,57%          | 8,76%         | 8,27%         | -3,44%        | -4,80%        | -0,69%        | 15,90%        | 9,30%         | 2,92%         |
| <b>2019</b> | <b>10,90%</b> | <b>-2,31%</b> | <b>-0,13%</b>  | <b>1,10%</b>  | <b>0,75%</b>   | <b>3,67%</b>  | <b>0,82%</b>  | <b>-0,39%</b> | <b>3,34%</b>  | <b>2,17%</b>  | <b>0,99%</b>  | <b>6,59%</b>  | <b>30,42%</b> |
| Ibovespa    | 10,82%        | -1,86%        | -0,18%         | 0,98%         | 0,70%          | 4,06%         | 0,84%         | -0,67%        | 3,57%         | 2,36%         | 0,95%         | 6,85%         | 31,58%        |
| <b>2018</b> | <b>11,82%</b> | <b>0,49%</b>  | <b>0,01%</b>   | <b>0,90%</b>  | <b>-10,92%</b> | <b>-5,08%</b> | <b>8,65%</b>  | <b>-3,11%</b> | <b>3,48%</b>  | <b>10,13%</b> | <b>2,71%</b>  | <b>-2,06%</b> | <b>15,71%</b> |
| Ibovespa    | 11,14%        | 0,52%         | 0,01%          | 0,88%         | -10,87%        | -5,20%        | 8,88%         | -3,21%        | 3,48%         | 10,19%        | 2,38%         | -1,81%        | 15,03%        |
| <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>-0,11%</b> | <b>-3,40%</b> | <b>6,55%</b>  | <b>17,35%</b> |
| Ibovespa    |               | 2,82%         | -2,52%         | 0,64%         | -4,12%         | 0,30%         | 4,80%         | 7,46%         | 4,88%         | 0,02%         | -3,15%        | 6,16%         | 17,84%        |

A rentabilidade do fundo não é líquida de impostos, mas é líquida de taxa de administração e de taxa de performance.

## INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

|                              |                                                              |                               |                                                                         |
|------------------------------|--------------------------------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|
| <b>Objetivo do Fundo</b>     | Superar o Ibovespa no longo prazo                            | <b>Taxa de Administração</b>  | 0,75% a.a. (máx. 1,50 a.a.)                                             |
| <b>Público Alvo</b>          | Investidores em Geral e Inv. enquadrados na res. 3922 do CMN | <b>Taxa de Performance</b>    | 10% do que exceder o Ibovespa (semestral), com marca d'água             |
| <b>Categoria ANBIMA</b>      | Ações Índice Ativo                                           | <b>Taxa de Ingresso/Saída</b> | Não há                                                                  |
| <b>Data de Início</b>        | 27 de setembro de 2021                                       | <b>Aplicação Mínima</b>       | R\$ 1.000.000,00                                                        |
| <b>Bloomberg Ticker</b>      | NESTIBE BZ                                                   | <b>Movimentação Mínima</b>    | R\$ 1.000,00                                                            |
| <b>Gestor</b>                | Nest Asset Management                                        | <b>Aplicações</b>             | D+0, para aplicações efetuadas até às 14h                               |
| <b>Custodiante</b>           | BNY Mellon Banco S.A.                                        | <b>Resgates</b>               | D+1 para resgates solicitados até às 14h, liquidação D+2 após conversão |
| <b>Auditoria</b>             | KPMG                                                         | <b>Administrador</b>          | BNY Mellon Serviços Financeiros                                         |
| <b>Patrimônio Líquido</b>    |                                                              | <b>SAC</b>                    | sac@bnymellon.com.br ou no telefone (21) 3219-2998                      |
| <b>PL Mês:</b>               | R\$ 103.142.891,26                                           | <b>Ouvidoria</b>              | ouvidoria@bnymellon.com.br ou no telefone 0800 7253219                  |
| <b>PL Médio em 12 meses:</b> | NA                                                           |                               |                                                                         |

Este documento foi produzido pela Nest International Administradora de Carteira de Valores Mobiliários LTDA ("Nest Asset Management"), as informações contidas nesse material possuem caráter exclusivamente informativo. A Nest Asset Management não comercializa, nem distribui cotas de fundos de investimentos. Fundos de Investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda do fundo garantidor de créditos - FGC. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade do fundo não é líquida de impostos, mas é líquida de taxa de administração e de taxa de performance. Para avaliação da performance do fundo de investimento é recomendável uma análise de no mínimo 12 (doze) meses. É recomendada a leitura cuidadosa do Formulário de Informações Essenciais, Lâmina CVM e Regulamento do fundo de investimento pelo investidor antes de investir seus recursos. Os fundos geridos pela Nest Asset Management utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Os investidores devem estar preparados para aceitar os riscos inerentes aos diversos mercados em que atuam e, consequentemente possíveis variações no patrimônio investido.

