

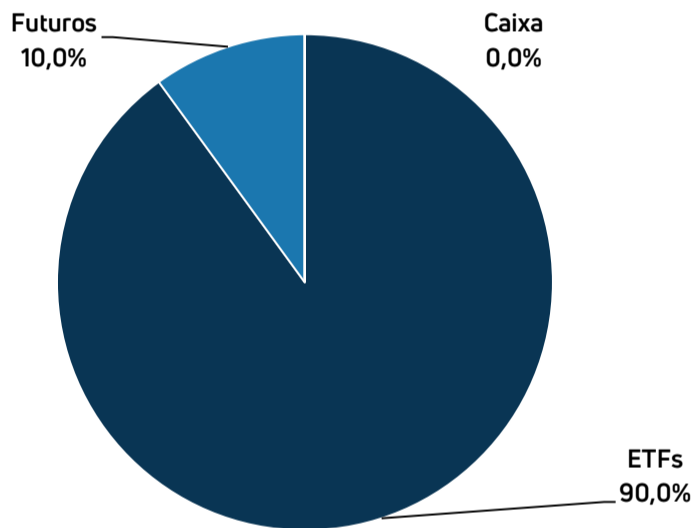


ESTRATÉGIA DE INVESTIMENTO

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.



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA



PERFORMANCE HISTÓRICA

Mês	FUNDO	Ibovespa	BOVA11
12M	-7,92%	-7,49%	-7,91%
24M	-4,39%	-7,26%	-7,12%
36M	-0,81%	-4,64%	-4,20%
YTD	5,81%	0,73%	0,55%
Desde Início	-4,45%	-4,38%	-4,53%
69,37%	61,84%	61,30%	
Estatísticas			
Exposição líquida média	99,99%		
Correlação com o Ibovespa	0,97		
Tracking error	4,06%		
Volatilidade anualizada	25,58%	25,27%	25,55%
Maior Drawdown	-46,33%	-46,82%	-47,03%
Meses positivos	44	45	44
Meses negativos	29	28	29
Meses acima do Ibovespa	39		
Meses abaixo do Ibovespa	34		

ATRIBUIÇÃO SETORIAL

Índices/ETF	Exposição	Contribuição
Índices/ETF	99,99%	-8,23%
Outros		
Caixa/Custos	0,01%	0,31%

MAIORES EXPOSIÇÕES¹

VALE ON (VALE3)	15,65%
ITAUUNIBANCO PN (ITUB4)	6,59%
PETROBRAS PN (PETR4)	6,23%
PETROBRAS ON (PETR3)	5,41%
BRADESCO PN (BBDC4)	3,64%
ELETRONBRAS ON (ELET3)	3,47%
B3 ON (B3SA3)	3,36%
AMBEV S/A ON (ABEV3)	3,17%
BRASIL ON (BBAS3)	3,09%
WEG ON (WEGE3)	2,79%
ITAUSA PN (ITSA4)	2,32%
LOCALIZA ON (RENT3)	2,32%
SUZANO S.A. ON (SUZB3)	1,88%
GERDAU PN (GGBR4)	1,69%
REDE D OR ON (RDOR3)	1,59%

¹ 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
2023	3,77%	-7,92%											-4,45%
Ibovespa	3,37%	-7,49%											-4,38%
2022	7,26%	0,91%	6,52%	-10,25%	3,85%	-10,96%	4,75%	7,01%	0,85%	5,27%	-2,85%	-2,09%	8,29%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%	5,45%	-3,06%	-2,45%	4,69%
2021	-3,62%	-4,48%	6,16%	2,13%	5,96%	0,39%	-3,86%	-2,60%	-6,70%	-6,21%	-1,10%	2,54%	-11,75%
Ibovespa	-3,32%	-4,37%	6,00%	1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	-11,93%
2020	-2,10%	-7,67%	-30,18%	11,66%	8,96%	8,92%	8,40%	-3,55%	-4,83%	-0,29%	15,70%	9,10%	4,74%
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%
2019	10,90%	-2,31%	-0,13%	1,10%	0,75%	3,67%	0,82%	-0,39%	3,34%	2,17%	0,99%	6,59%	30,42%
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%
2018	11,82%	0,49%	0,01%	0,90%	-10,92%	-5,08%	8,65%	-3,11%	3,48%	10,13%	2,71%	-2,06%	15,71%
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%
2017		2,58%	-2,64%	0,73%	-4,47%	0,36%	5,16%	7,73%	4,46%	-0,11%	-3,40%	6,55%	17,35%
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.

Histórico de rentabilidade do período anterior a data da cisão em 27/09/2021 são do Nest FIA (CNPJ 41.215.368/0001-54)

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Objetivo do Fundo	Superar o Ibovespa no longo prazo	Taxa de Administração	0,75% a.a. (máx. 1,50 a.a.)
Público Alvo	Investidores em Geral	Taxa de Performance	10% do que exceder o Ibovespa (semestral), com marca d'água
Categoria ANBIMA	Ações Índice Ativo	Taxa de Ingresso/Saída	Não há
Data de Início	27 de setembro de 2021	Aplicação Mínima	R\$ 1.000.000,00
Bloomberg Ticker	NESTIBE BZ <Equity>	Movimentação Mínima	R\$ 1.000,00
Gestor	Nest Asset Management	Aplicações	D+0, para aplicações efetuadas até às 14h
Custodiante	BNY Mellon Banco S.A.	Resgates	D+1 para resgates solicitados até às 14h, liquidação D+2 após conversão
Auditoria	KPMG	Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros
Patrimônio Líquido		SAC	sac@bnymellon.com.br ou no telefone (21) 3219-2998
PL Mês:	R\$ 92.643.894,78	Ouvidoria	ouvidoria@bnymellon.com.br ou no telefone 0800 7253219
PL Médio em 12 meses:	R\$ 106.870.269,89		

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.

