Norte Long Bias FIC FIM

Setembro 2022

Gestor
Norte Asset Management Gestão de Recursos S.A.

Administração e Custódia
S3 Caceis Brasil DTVM S.A.

CNPJ
37.467.515/0001-06

Categoria Anbima
Multimercados Livre

Público Alvo
Investidores qualificados

Taxa de Administração
1,80% a.a. (+ 0,20% no fundo Master)

Taxa de Performance
20% sobre o que exceder o Benchmark

Taxa Resgate Antecipado
5% revertida ao próprio fundo

Tributação
Alíquota de IR de 15% incidida sobre o lucro obtido no momento do resgate

Data de início
29/01/2021

Aplicação inicial mínima
R$ 10.000,00

Movimentação mínima
R$ 1.000,00

Cota de aplicação
D+1 e liquidação em D+0

Cota de resgate
D+30 corridos e liquidação em D+2 úteis

Objetivo

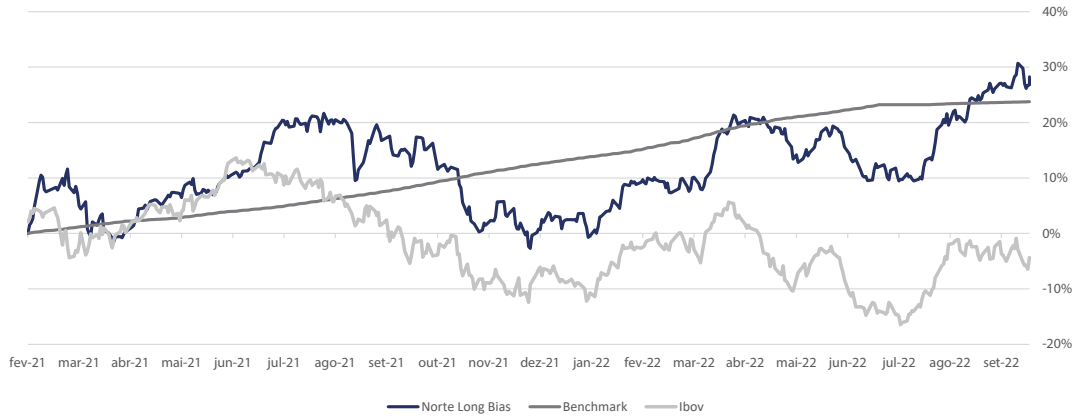
Proporcionar, no longo prazo, ganhos de capital para o cotista através de uma gestão ativa de investimentos em ações, juros, câmbio e mercado internacional. Tem como objetivo retorno absoluto superior ao rendimento do juro real (IPCA + média ponderada das taxas dos títulos do IMA-B).

Rentabilidade Mensal[1]

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2021	**Norte Long Bias**	-	**7,35%**	**-6,61%**	**6,99%**	**3,04%**	**7,60%**	**0,64%**	**-0,73%**	**-2,86%**	**-13,15%**	**-2,56%**	**6,07%**	**3,61%**	**3,61%**
	Benchmark[2]	-	0,77%	1,48%	0,53%	0,98%	0,86%	1,24%	1,02%	1,59%	1,40%	1,49%	1,09%	13,50%	13,50%
	Ibovespa	-	-4,37%	6,00%	1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	-8,90%	-8,90%
2022	**Norte Long Bias**	**5,62%**	**-1,23%**	**9,66%**	**0,39%**	**-1,20%**	**-4,71%**	**1,46%**	**9,43%**	**3,09%**				**23,77%**	**28,23%**
	Benchmark[2]	1,01%	1,37%	1,77%	1,35%	1,07%	1,26%	0,01%	0,29%	0,19%				8,94%	23,78%
	Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%				4,97%	-4,37%

[1] Rentabilidade líquida de taxas de administração e performance e bruta de impostos
[2] IPCA + média ponderada das taxas dos títulos do IMA-B

Rentabilidade Acumulada



Comentário

O Norte Long Bias rendeu 3,09% em setembro, versus 0,19% do benchmark e 0,47% do Ibovespa. Em um mês marcado pela alta volatilidade dos ativos de risco no Brasil, as principais contribuições positivas vieram do setor de crescimento doméstico, com destaque para construção civil e varejo, seguido por *financials* e saúde. O *book* global agregou à performance com os *shorts* nos setores de consumo básico e *home builders*. As principais detratoras foram as ações das empresas petrolíferas e do setor de transportes. O livro macro obteve ganhos com as estratégias tomadas em juros *offshore* e com as posições compradas no dólar estadunidense contra uma cesta de moedas ligadas à economia europeia. No ano, o fundo acumula rentabilidade de 23,77%, contra 4,97% do Ibovespa e 8,94% do benchmark.

Análise Estatística

Rentabilidade - 12 meses	11,09%	**Volatilidade anualizada 21 d.u.**	13,94%
Maior retorno mensal	9,66%	**Índice de Sharpe desde início**	0,51
Menor retorno mensal	-13,15%	**Patrimônio líquido atual**	R$ 372.897.256,55
Meses acima do Benchmark	10	**Patrimônio líquido médio - 12 meses**	R$ 245.022.037,87
Meses abaixo do Benchmark	10	**Patrimônio líquido estratégia**	R$ 1.010.726.444,45

Norte Asset Management Gestão de Recursos S.A.
Av. Brigadeiro Faria Lima, 3.015 - 11º andar - CJ 112 | Itaim Bibi | São Paulo - SP | 01452-000
11 2780-0340 | contato@norteasset.com.br | www.norteasset.com.br

S3 Caceis Brasil DTVM S.A.
Rua Amador Bueno n. 474, 1º andar – Bloco D | Santo Amaro | São Paulo - SP | 04752-005
11 4004-4412 | sc_faleconosco@s3caceis.com.br | www.s3dtvm.com.br

As informações contidas neste material de divulgação são de caráter exclusivamente informativo. A Norte Asset não comercializa e nem realiza a distribuição de cotas de fundos de investimentos por isso para investir em nossos fundos entre em contato com um distribuidor autorizado. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador, gestor, ou qualquer outro mecanismo de seguro, ou pelo FGC – Fundo Garantidor de Crédito. Os fundos da Norte Asset podem adotar estratégias com derivativos como parte da sua política de investimentos, que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. A rentabilidade divulgada para nossos fundos não é líquida de impostos e taxa de saída. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RESULTADOS FUTUROS. RECOMENDAMOS A LEITURA CUIDADOSA DO REGULAMENTO DO FUNDO, FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, E LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS, SE HOUVER, ANTES DE INVESTIR. ESTE FUNDO TEM MENOS DE 12 (DOZE) MESES, PARA AVALIAÇÃO DA PERFORMANCE DE FUNDO(S) DE INVESTIMENTO(S), É RECOMENDÁVEL A ANÁLISE DE , NO MÍNIMO, 12 (DOZE) MESES. É expressamente proibida a reprodução e circulação deste material, em todo ou em parte, sem a prévia autorização, por escrito, da Norte Asset, que não se responsabiliza por eventuais erros ou pelo uso das informações contidas neste material. A Norte Asset possui os seguintes canais de comunicação: tel (11) 2780-0340 ou através do site www.norteasset.com.br na seção Contato. Este fundo tem a supervisão e fiscalização da Comissão de Valores Mobiliários ("CVM"), Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br

Autorregulação ANBIMA
Gestão de Recursos