

RIO BRAVO FUNDAMENTAL FIA

Renda Variável

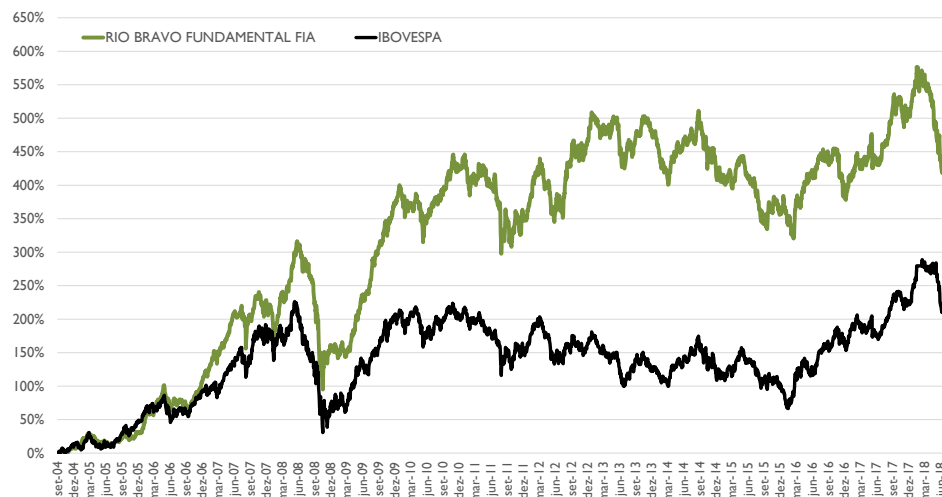


PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

| | | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | ANO |
|-------|------------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2018 | Fundo | 7.99 | -3.65 | 0.34 | -5.30 | -9.56 | -4.77 | - | - | - | - | - | - | -14.85 |
| | Ibovespa | 11.14 | 0.52 | 0.01 | 0.88 | -10.87 | -5.20 | - | - | - | - | - | - | -4.76 |
| | # Ibovespa | -3.15 | -4.17 | 0.32 | -6.18 | 1.31 | 0.43 | - | - | - | - | - | - | -10.09 |
| 2017 | Fundo | 2.99 | 3.54 | 0.37 | 2.40 | -2.45 | 0.73 | 3.85 | 5.54 | 3.46 | 0.55 | -3.13 | 4.90 | 24.78 |
| | Ibovespa | 7.38 | 3.08 | -2.52 | 0.64 | -4.12 | 0.30 | 4.80 | 7.46 | 4.88 | 0.02 | -3.15 | 6.16 | 26.86 |
| | # Ibovespa | -4.39 | 0.46 | 2.89 | 1.75 | 1.67 | 0.43 | -0.95 | -1.92 | -1.42 | 0.53 | 0.01 | -1.26 | -2.08 |
| 2016 | Fundo | -5.42 | -5.59 | 10.07 | 6.04 | 3.43 | 2.09 | 3.92 | -1.37 | -0.39 | 2.82 | -8.44 | -1.22 | 4.50 |
| | Ibovespa | -6.79 | 5.91 | 16.97 | 7.70 | -10.09 | 6.30 | 11.22 | 1.03 | 0.80 | 11.23 | -4.65 | -2.71 | 38.94 |
| | # Ibovespa | 1.37 | -11.50 | -6.90 | -1.66 | 13.52 | -4.21 | -7.30 | -2.40 | -1.19 | -8.42 | -3.79 | 1.49 | -34.44 |
| Anual | | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 | 2009 | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 |
| | Fundo | 9.19 | 20.73 | 68.19 | 45.22 | -21.33 | 93.46 | 10.12 | -16.32 | 32.79 | -3.13 | -9.28 | -9.07 | 4.50 |
| | Ibovespa | 16.25 | 27.71 | 32.93 | 43.65 | -41.22 | 82.66 | 1.04 | -18.11 | 7.40 | -15.50 | -2.91 | -13.31 | 38.94 |
| | # Ibovespa | -7.06 | -6.98 | 35.26 | 1.57 | 19.89 | 10.81 | 9.08 | 1.79 | 25.39 | 12.36 | -6.37 | 4.25 | -34.44 |

| | | | |
|-----------------------------------|----------------|----------------------------|----------|
| FUNDO DESDE O INÍCIO (%) | 432.0 | VALOR DA COTA DO FUNDO | 5.319793 |
| IBOVESPA DESDE O INÍCIO (%) | 222.9 | SHARPE DESDE O INÍCIO | 0.07 |
| ALPHA IBOVESPA DESDE O INÍCIO (%) | 209.1 | SHARPE 12 MESES | -0.02 |
| PL ATUAL | R\$ 8,343,919 | MAX DRAWDOWN (%) | -30.84 |
| PL MÉDIO 12 MESES | R\$ 11,588,540 | VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL) | -1.36 |
| VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%) | 19.0 | VAR HISTÓRICO DIA (% PL) | -2.09 |
| VOLATILIDADE 12 MESES (%) | 16.2 | STRESS (% PL) | -7.00 |

PERFORMANCE RELATIVA (%)



ALOCÇÃO SETORIAL

| | % PL |
|---------------------|------|
| ALIMENTOS E BEBIDAS | 3% |
| QUÍMICA | 9% |
| BENS CAPITAL | 10% |
| TELECOM | 10% |
| FINANÇAS | 24% |
| OUTROS | 44% |

CONSISTÊNCIA DE RETORNO (%)

| | Fundo | # Ibov. |
|------------------|--------|---------|
| ACUMULADO 2018 | -14.85 | -10.09 |
| ÚLTIMOS 12 MESES | -1.34 | -17.02 |
| 24 MESES | 4.14 | -43.61 |
| 36 MESES | 5.74 | -31.34 |
| 48 MESES | -5.00 | -42.21 |
| DESDE INÍCIO | 431.98 | 209.08 |

Recomendações ao investidor: Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. • Para avaliação do desempenho de fundo(s) de investimento(s), é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. • Este documento tem um caráter meramente informativo e não deve ser considerado como uma oferta de aquisição de cotas dos fundos de investimentos. • Performance passada não é garantia de ganhos futuros. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador ou por qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo fundo garantidor de crédito. • A rentabilidade não é líquida de impostos. • A Rio Bravo Investimentos S.A. não se responsabiliza por quaisquer decisões tomadas tendo como base os dados neste documento. • Todo o material aqui contido, incluindo os textos, gráficos, imagens e qualquer outro material de comunicação audiovisual são de propriedade única e exclusiva da Rio Bravo, bem como quaisquer informações, relatórios, produtos e serviços, que conjuntamente compõem valiosa propriedade intelectual da Rio Bravo. • O material aqui veiculado deve ser entendido como de uso pessoal. • Não é permitido qualquer tipo de transmissão, cópia ou adulteração sem o exposto escrito consentimento da Rio Bravo, sob pena de se tratar clara infração aos direitos de propriedade da Rio Bravo, acarretando as devidas sanções legais. • As informações aqui contempladas não constituem qualquer tipo de oferta ou recomendação de investimento. • A Rio Bravo não é responsável por qualquer utilização não autorizada do material e das informações aqui dispostas.

JUN-18

Rio Bravo Investimentos S.A
www.riobravo.com.br

Contatos

Investidores Institucionais
(11) 3509-6639
institucionais@riobravo.com.br
Investidores Individuais
(11) 3509-6622
invista@riobravo.com.br

Características do Fundo

O Rio Bravo Fundamental Fundo de Investimento em Ações é um fundo não-alavancado de investimento em ações que busca maximizar a rentabilidade da carteira no longo prazo, com orientação para valor e, frequentemente uma postura ativista em governança corporativa.

Política de Investimentos

O fundo selecionará ativos por meio de análise fundamentalista, tendo como base o diferencial existente entre seu valor intrínseco e seu preço de mercado. O fundo manterá posições de longo prazo, dando prioridade à consistência de resultados e à qualidade das empresas e seus modelos de gestão.

Objetivo do Fundo

Valorização a médio e longo prazo de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos preponderantemente em empresas promissoras do mercado brasileiro.

Público-Alvo

Destina-se a receber, aplicação de (i) pessoas físicas e pessoas jurídicas em geral, (ii) Fundos de Investimentos e (iii) Investidores Institucionais, incluindo, mas não se limitando a Entidades Fechadas de Previdência Complementar ("EFPC") e Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios ("RPPS"), e/ou veículos de investimentos e profissionais do Grupo Rio Bravo.

Benchmark

Ibovespa

Estilo de Gestão

Fundo de valor e governança.

Informações do Produto

Administrador • BEM DTVM Ltda. (Grupo Bradesco)

Gestor • Fundamental Investimentos Ltda.

Código ISIN • BRRBFNCTF002

Custódia e Controladoria • Banco Bradesco S/A

Auditor • KPMG

Aplicação Inicial • R\$5.000,00

Saldo Mínimo de Permanência • R\$5.000,00

Movimentação Mínima • R\$1.000,00

Aplicação • Cota do dia da aplicação

Taxa de Administração • 2% a.a.

Taxa de Performance • 20% do que exceder o Ibovespa

Data de Início • 8 de Setembro de 2004

Código Anbima • 141690

Classificação • Ações Livre

Perfil de Risco • Arrojado

Dados Bancários • Fav.: Rio Bravo Fundamental FIA -

Banco Bradesco (237) - Ag. 2856

C/c 586.854-8 - CNPJ 06.940.782/0001-25

Resgate / Conversão • D+12 dias corridos para cotização.

Após cotização, crédito em d+3

Cota • Fechamento

Horário para solicitação de resgates e aplicações

• 9h00 às 14h00

Imposto de Renda • Aliquota de 15% sobre o

rendimento no dia da cotização do resgate.



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.