

# RIO BRAVO FUNDAMENTAL FIA

Renda Variável

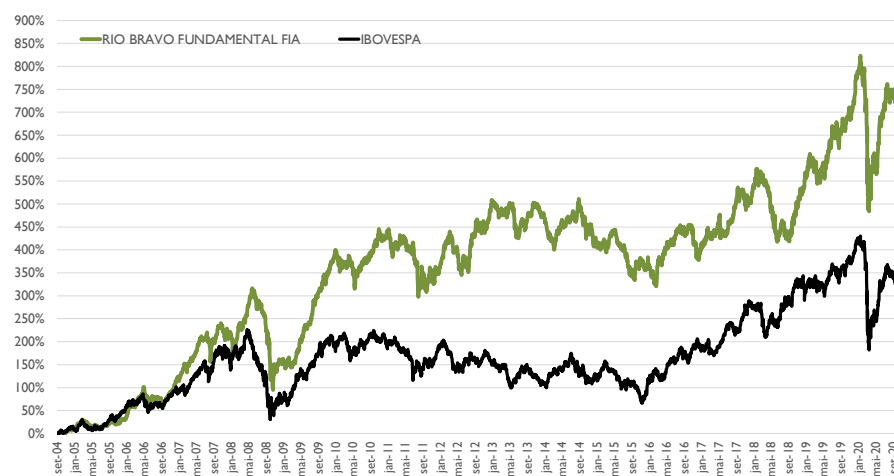


## PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2020	Fundo	1.06	-8.49	-20.89	7.93	6.13	8.70	6.14	-1.54	-3.44	-	-	-	-8.09
	Ibovespa	-1.63	-8.43	-29.90	10.25	8.57	8.76	8.27	-3.44	-4.80	-	-	-	-18.20
	# Ibovespa	2.69	-0.06	9.01	-2.32	-2.44	-0.05	-2.12	1.90	1.35	-	-	-	10.11
2019	Fundo	7.81	-2.39	-2.89	2.65	3.26	2.93	3.93	0.54	3.50	0.40	2.36	8.28	34.19
	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
	# Ibovespa	-3.01	-0.53	-2.71	1.67	2.55	-1.13	3.09	1.21	-0.07	-1.96	1.41	1.44	2.61
2018	Fundo	7.99	-3.65	0.34	-5.30	-9.56	-4.77	2.98	-2.87	1.83	10.97	4.41	3.73	4.23
	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
	# Ibovespa	-3.15	-4.17	0.32	-6.18	1.31	0.43	-5.90	0.34	-1.64	0.78	2.03	5.54	-10.80
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
Annual		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
		-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 (%)	<b>703.2</b>	VALOR DA COTA DO FUNDO	<b>8.031846</b>
IBOVESPA DESDE O INÍCIO (%)	<b>330.6</b>	SHARPE DESDE O INÍCIO	<b>0.10</b>
ALPHA IBOVESPA DESDE O INÍCIO (%)	<b>372.54</b>	SHARPE 12 MESES	<b>0.25</b>
PL ATUAL	<b>R\$ 4,446,284</b>	MAX DRAWDOWN (%)	<b>-53.21</b>
PL MÉDIO 12 MESES	<b>R\$ 4,283,691</b>	VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	<b>-1.92</b>
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	<b>20.0</b>	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	<b>-1.75</b>
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	<b>32.4</b>	STRESS (% PL)	<b>-22.29</b>

## PERFORMANCE RELATIVA (%)



## ALOCÇÃO SETORIAL

	% PL
ALIMENTOS E BEBIDAS	11.1%
QUÍMICA	0%
TELECOM	0%
BENS CAPITAL	0%
FINANÇAS	8.2%
OUTROS	70.7%

## CONSISTÊNCIA DE RETORNO (%)

	Fundo	# Ibov.
ACUMULADO 2020	-8.09	10.11
ÚLTIMOS 12 MESES	2.28	11.97
24 MESES	47.12	28.86
36 MESES	29.31	2.23
48 MESES	48.27	-12.09
DESDE INÍCIO	703.2	372.54

**SEP-20**  
Rio Bravo Investimentos S.A  
[www.riobravo.com.br](http://www.riobravo.com.br)

**Contatos**  
Investidores Institucionais  
(11) 3509-6639  
[institucionais@riobravo.com.br](mailto:institucionais@riobravo.com.br)  
Investidores Individuais  
(11) 3509-6622  
[investa@riobravo.com.br](mailto:investa@riobravo.com.br)

**Características do Fundo**  
O Rio Bravo Fundamental FIA é um fundo de ações long-only não-alavancado que busca retornos consistentes de longo prazo utilizando uma filosofia de investimentos orientada a valor.

**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** • BRRFNCTF002  
**Custódia e Controladoria** • Banco Bradesco S/A  
**Auditor** • KPMG

**Aplicação Inicial** • R\$1.000,00  
**Saldo Mínimo de Permanência** • R\$5.000,00  
**Movimentação Mínima** • R\$1.000,00  
**Aplicação** • Cota do dia da aplicação  
**Taxa de Administração** • 0,50% a.a | PL até 20 M  
1,60% a.a | PL Acima de 20 M

**Taxa de Performance** • 20% do que exceder o Ibovespa  
**Data de Início** • 8 de Setembro de 2004  
**Código Anbima** • 141690  
**Classificação** • Ações Livres  
**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.

**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 o valor da 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 expresso escrito consentimento da Rio Bravo, sob pena de se tratar clara e inequívoca de 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.

