

RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

Multi-Assets



PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

ABR-21		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2021	Fundo	-0.48	1.49	-0.12	1.49	-	-	-	-	-	-	-	-	2.37
	Rio Bravo Investimentos S.A	0.15	0.13	0.20	0.21	-	-	-	-	-	-	-	-	0.69
	% CDI	-	1104.2	-	715.6	-	-	-	-	-	-	-	-	342.3
2020	Fundo	0.98	0.52	3.58	-0.32	0.60	0.02	0.66	-0.65	-1.22	-0.34	-0.98	1.46	4.29
	CDI	0.38	0.29	0.34	0.28	0.24	0.21	0.19	0.16	0.16	0.16	0.15	0.16	2.76
	% CDI	259.6	175.9	1058.8	-	254.6	10.3	338.2	-	-	-	-	888.4	155.6
2019	Fundo	2.89	0.53	0.32	0.88	2.34	-0.46	-0.45	-0.46	-1.61	0.71	-0.33	-0.88	3.43
	CDI	0.54	0.49	0.47	0.52	0.54	0.47	0.57	0.50	0.46	0.48	0.38	0.37	5.96
	% CDI	532.6	107.6	68.4	169.4	430.3	-	-	-	-	147.5	-	-	57.6
2018	Fundo	2.05	2.40	2.13	-0.99	1.88	1.90	-0.06	1.27	0.69	-1.41	0.14	2.48	13.12
	CDI	0.58	0.46	0.53	0.52	0.52	0.52	0.54	0.57	0.47	0.54	0.49	0.49	6.42
	% CDI	352.1	516.4	401.6	-	362.6	367.8	-	224.5	148.3	-	28.3	503.3	204.4
Anual		2015	2016	2017										
	Fundo	3.64	9.61	12.41										
	CDI	5.06	14.00	9.93										
	% CDI	71.92	68.62	125.03										

Objetivo do Fundo
O FUNDO tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital, no longo prazo superior a rentabilidade dos Certificados de Depósito Interbancário - CDI.
A Política de Investimento consiste na alocação de parte dos seus recursos em renda variável, títulos públicos ou privados, cotas de fundos de investimentos e operações no mercado derivativo (inclusive operações vendidas) sem compromisso de limites de concentração de fator de risco.

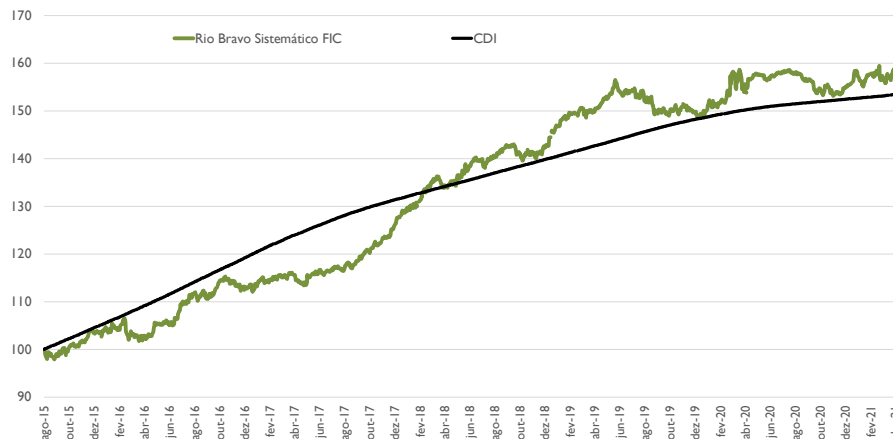
Público-Alvo
Público em geral

Informações do Produto
Administrador • BEM DTVM Ltda. (Grupo Bradesco)
Gestor • Rio Bravo Investimentos Ltda.
Distribuidor • Rio Bravo DTVM & Guide S.A.
Custódia • Banco Bradesco S.A.
Controladoria • Banco Bradesco S.A.
Auditor • KPMG
Aplicação Inicial • R\$ 100,00
Saldo mínimo • R\$ 1.000,00
Movimentação mínima • R\$ 100,00
Aplicação • Conversão D+0 d.u.
Resgate • Conversão D+15 Corridos
Liquidação Financeira • Primeiro dia útil subsequente à Data da Conversão
Taxa de Administração • 1,50% a.a.
Taxa de Performance • 20% a.a. excesso 100% CDI
Início do Fundo • 17 de agosto de 2015
Código ANBIMA • 402362
Classificação • Multimercado Livre
Perfil de Risco • Arrojado
Cota • Fechamento
Dados Bancários
Fav.: Rio Bravo Sistemático FIC FIM
- Banco Bradesco (237) - Ag. 2856 -
C/c 9738-I - CNPJ 22.407.091/0001-17

Horário para Solicitação de Resgates e Aplicações • 9h00 às 14h00
Imposto de Renda • Retido semestralmente maio e novembro, alíquota de 15% e/ou 22,5% em aplicações até 180 dias. 20% em aplicações de 181 a 360 dias. 17,5% em aplicações de 361 a 720 dias. 15% em aplicações superiores a 720 dias.
IOF • Os resgates com prazo inferior a 30 (trinta) dias da data de aplicação sofrerão tributação pelo IOF

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	59.51	STRESS (% PL)	-6.24
CDI DESDE O INÍCIO (%)	53.61	VALOR DA COTA DO FUNDO	159.507221
% CDI DESDE O INÍCIO	111.0	SHARPE DESDE O INÍCIO	0.16
PL ATUAL	R\$ 12,839,765	SHARPE 12 MESES	-0.04
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 7,291,323	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MASTER ATUAL	R\$ 12,804,693	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	4.98	NÚMERO MESES POSITIVOS	51
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	4.08	NÚMERO MESES NEGATIVOS	18
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.56	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	36
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.63	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	33

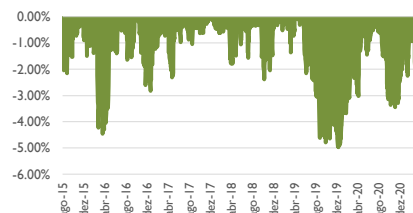
PERFORMANCE RELATIVA (%)



CORRELAÇÕES

	SISTEMATICO	IBOVESPA	S&P500	IHFA	IFIX	DOLAR	OURO
SISTEMATICO	1.0	0.06	0.03	0.07	-0.14	0.15	0.11
IBOVESPA	0.06	1.0	0.52	0.87	0.25	-0.25	-0.31
S&P500	0.03	0.52	1.0	0.65	0.21	-0.16	-0.16
IHFA	0.07	0.87	0.65	1.0	0.29	-0.23	-0.18
IFIX	-0.14	0.25	0.21	0.29	1.0	-0.29	-0.21
DOLAR	0.15	-0.25	-0.16	-0.23	-0.29	1.0	0.42
OURO	0.11	-0.31	-0.16	-0.18	-0.21	0.42	1.0

MAX DRAWDOWN



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 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 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.



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