

# RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

## Multi-Assets



### PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

SET-21		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2021	Fundo	-0.48	1.49	-0.12	1.49	-1.04	-1.28	1.01	0.79	1.84	-	-	-	3.69
	CDI	0.15	0.13	0.20	0.21	0.27	0.31	0.36	0.42	0.44	-	-	-	2.51
	% CDI	-	1104.2	-	715.6	-	-	284.3	184.2	417.4	-	-	-	146.8
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.

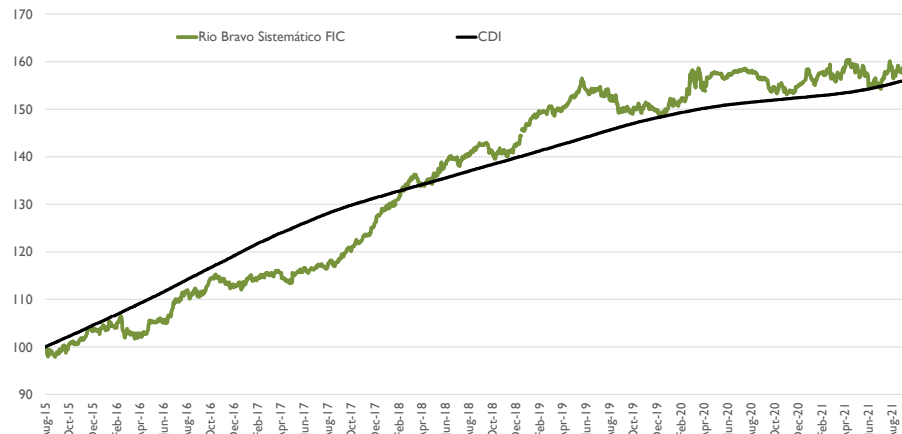
**Público-Alvo**  
Público em geral

**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** • Pricewaterhousecoopers  
**Aplicação Inicial** • R\$ 100,00  
**Saldo mínimo** • R\$ 100,00  
**Movimentação mínima** • R\$ 100,00  
**Aplicação** • Conversão D+0 du  
**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 9738-1 - 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 (%)	61.57	STRESS (% PL)	-5.99
CDI DESDE O INÍCIO (%)	56.40	VALOR DA COTA DO FUNDO	161.568654
% CDI DESDE O INÍCIO	109.2	SHARPE DESDE O INÍCIO	0.13
PL ATUAL	R\$ 11,359,841	SHARPE 12 MESES	0.16
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 10,843,194	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MASTER ATUAL	R\$ 11,277,000	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.22	NÚMERO MESES POSITIVOS	54
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	6.37	NÚMERO MESES NEGATIVOS	20
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.74	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	39
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.74	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	35

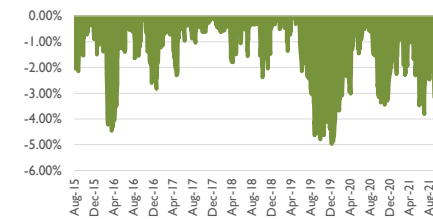
### PERFORMANCE RELATIVA (%)



### CORRELAÇÕES

Rio Bravo Sistemático	Bovespa	S&P500	IHFA	IFIX	Dólar	Ouro	
Rio Bravo Sistemático	1	-0.02	-0.07	-0	-0.12	0.1	-0.01
Bovespa	-0.02	1	0.6	0.76	0.47	-0.38	-0.31
S&P500	-0.07	0.6	1	0.56	0.32	-0.21	-0.17
IHFA	-0	0.76	0.56	1	0.48	-0.31	-0.21
IFIX	-0.12	0.47	0.32	0.48	1	-0.29	-0.1
Dólar	0.1	-0.38	-0.21	-0.31	-0.29	1	0.38
Ouro	-0.01	-0.31	-0.17	-0.21	-0.1	0.38	1

### 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 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 expresso escrito consentimento da Rio Bravo, sob pena de se tratar clara a 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.