

RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

Multi-Assets



PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
DEC-20	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	-113.5	254.6	10.3	338.2	-406.1	-776.1	-217.2	-658.7	888.4	155.6
2020	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	-98.2	-79.1	-90.9	-348.1	147.5	-87.2	-235.2	57.6
2019	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	-191.5	362.6	367.8	-11.8	224.5	148.3	-260.2	28.3	503.3	204.4
2018	Fundo	1.27	0.14	0.10	-1.09	1.61	0.20	1.05	0.29	1.72	1.96	1.21	3.36	12.41
	CDI	1.08	0.86	1.05	0.79	0.93	0.81	0.80	0.80	0.64	0.64	0.57	0.54	9.93
	% CDI	117.4	16.1	9.7	-138.3	173.6	24.2	131.6	36.3	270.3	305.2	212.6	625.7	125.0
2017	Fundo	3.64	9.61											
	CDI	5.06	14.00											
	% CDI	71.92	68.62											
Anual	Fundo	3.64	9.61											
	CDI	5.06	14.00											
	% CDI	71.92	68.62											

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.

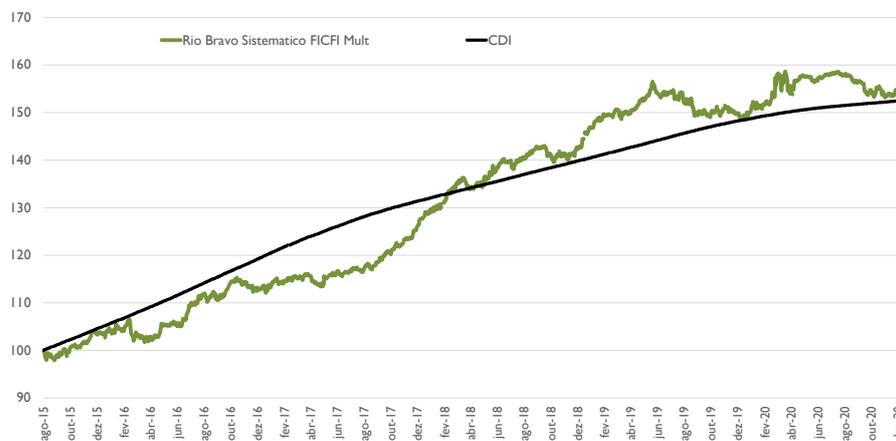
IOF • Os resgates com prazo inferior a

30 (trinta) dias da data de aplicação

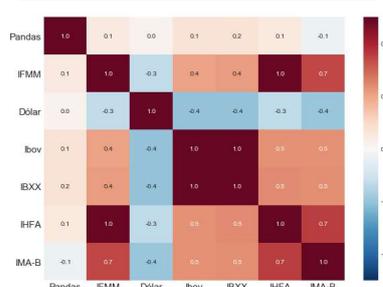
sofrerão tributação pelo IOF

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	55.81	STRESS (% PL)	-6.16
CDI DESDE O INÍCIO (%)	52.55	VALOR DA COTA DO FUNDO	155.813984
% CDI DESDE O INÍCIO	106.2	SHARPE DESDE O INÍCIO	0.10
PL ATUAL	R\$ 13,638,650	SHARPE 12 MESES	0.31
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 4,213,727	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MASTER ATUAL	R\$ 13,439,182	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	4.93	NÚMERO MESES POSITIVOS	48
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	5.30	NÚMERO MESES NEGATIVOS	17
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.37	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	34
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.52	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	31

PERFORMANCE RELATIVA (%)



CORRELAÇÕES



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 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.