

# RIO BRAVO FUNDAMENTAL FIA

Renda Variável



Aug-22

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

Contatos  
Investidores Institucionais  
ri@riobravo.com.br  
institucionais@riobravo.com.br  
www.riobravo.com.br/onde-investir

## Características do Fundo

O Fundo possui compromisso de concentração em renda variável e índices de ações e 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. Para fins de proteção e/ou captura de oportunidades, o fundo poderá investir em outras classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, cambial, derivativos e cotas de fundos de investimento, negociados nos mercados interno e externo.

## 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

(i) pessoas físicas e pessoas jurídicas em geral, (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.

## Informações do Produto

Administrador: BEM DTVM Ltda. (Grupo Bradesco)  
Gestor: Rio Bravo Investimentos Ltda.  
Distribuidor: Rio Bravo DTVM  
Custódia Banco Bradesco S.A  
Controladora: Banco Bradesco S.A  
Auditor: KPMG  
Aplicação Mínima: R\$ 1.000  
Saldo mínimo: R\$ 1.000  
Aplicação Adicional: R\$ 100  
Valor Mínimo de Resgate: R\$ 100  
Resgate: Conversão D+1 / Crédito D+12  
Taxa de Administração: 0.50% a.a. I PL até 20 M  
1,60% a.a I PL acima de 20 M  
Início do Fundo: 8 de setembro de 2004  
Código ANBID 141690  
Classificação: Fundo de ações  
Perfil de Risco: Arrojado  
Cota: Fechamento  
Dados Bancários:  
Rio Bravo Fundamental FIA - Banco Bradesco (237) - Ag. 2856 - C/c 586.854-8 - CNPJ 06.940.782/0001-25  
Horário para Solicitação de Resgates e Aplicações: 9h00 às 14h00  
Imposto de Renda: Retido  
semestralmente em 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.

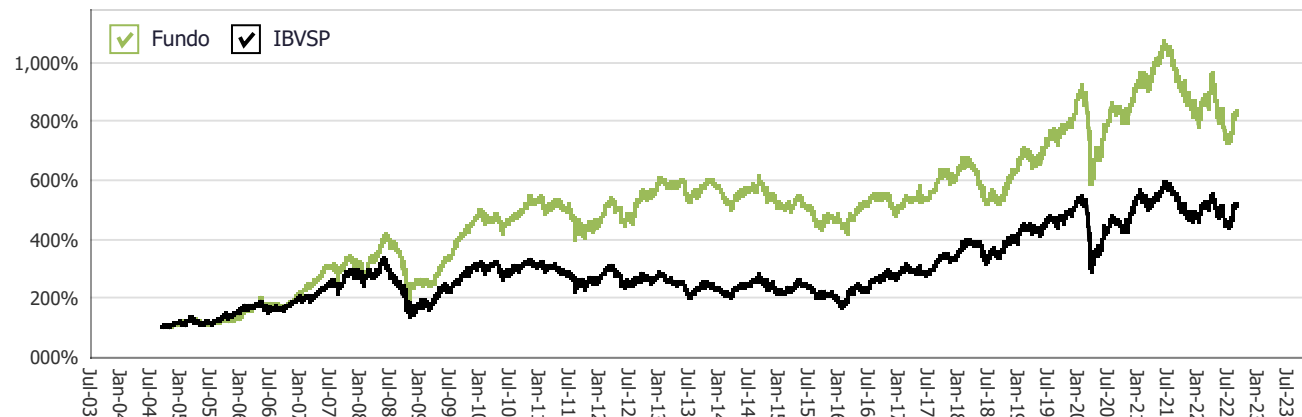
## PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	
<b>2022</b>														
Fundo	5.01%	-0.27%	7.70%	-10.08%	-1.07%	-12.61%	4.56%	5.16%	-	-	-	-	-3.59%	
IBVSP	6.98%	0.89%	6.06%	-10.10%	3.22%	-11.50%	4.69%	6.16%	-	-	-	-	4.48%	
Alpha	-	-	1.64%	0.02%	-	-	-	-	-	-	-	-	-8.07%	
<b>2021</b>														
Fundo	-2.09%	-1.68%	8.29%	2.10%	6.02%	-1.84%	-4.58%	-3.79%	-3.71%	-6.75%	-2.85%	0.56%	-10.80%	
IBVSP	-3.32%	-4.37%	6.00%	1.94%	6.16%	0.46%	-3.94%	-2.48%	-6.57%	-6.74%	-1.53%	2.85%	-11.93%	
Alpha	1.23%	2.70%	2.29%	0.16%	-	-	-	-	2.86%	-	-	-	1.13%	
<b>2020</b>														
Fundo	1.06%	-8.49%	-20.89%	7.93%	6.13%	8.70%	6.14%	-1.54%	-3.44%	-1.28%	10.12%	7.20%	7.12%	
IBVSP	-1.63%	-8.43%	-29.90%	10.25%	8.57%	8.76%	8.27%	-3.44%	-4.80%	-0.69%	15.90%	9.30%	2.92%	
Alpha	2.69%	-	9.01%	-	-	-	-	1.90%	1.35%	-	-	-	4.20%	
<b>2019</b>														
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%	
IBVSP	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%	
Alpha	-	-	-	1.67%	2.55%	-	3.09%	1.21%	-	-	1.41%	1.44%	2.61%	
<b>2018</b>														
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%	
IBVSP	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%	
Alpha	-	-	0.32%	-	1.31%	0.43%	-	0.34%	-	0.78%	2.03%	5.54%	-10.80%	
	<b>2004</b>	<b>2005</b>	<b>2006</b>	<b>2007</b>	<b>2008</b>	<b>2009</b>	<b>2010</b>	<b>2011</b>	<b>2012</b>	<b>2013</b>	<b>2014</b>	<b>2015</b>	<b>2016</b>	<b>2017</b>
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%	24.78%
IBVSP	19.25%	27.71%	32.93%	43.65%	-41.22%	82.66%	1.04%	-18.11%	7.40%	-15.50%	-2.91%	-13.31%	38.94%	26.86%
Alpha	-10.06%	-6.98%	35.26%	1.57%	19.89%	10.81%	9.08%	1.79%	25.39%	12.36%	-6.37%	4.25%	-34.44%	-2.08%

## INDICADORES

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	<b>705.04%</b>	VALOR DA COTA DO FUNDO	<b>8.0504</b>
IBVSP DESDE O INÍCIO (%)	<b>398.55%</b>	SHARPE DESDE O INÍCIO	<b>0.26</b>
% IBVSP DESDE O INÍCIO	<b>176.90%</b>	SHARPE 12 MESES	<b>0.06</b>
PL ATUAL	<b>10,595,223.32</b>	MAX DRAWDOWN (%)	<b>-53.212%</b>
PL MÉDIO 12 MESES	<b>5,752,920.07</b>	VAR PARAMETRICO DIA (% PL)	<b>-2.00%</b>
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	<b>1.256%</b>	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	<b>-2.07%</b>
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	<b>19.942%</b>	STRESS (% PL)	<b>-8.81%</b>

## PERFORMANCE RELATIVA (%)



## ALOCÇÃO SETORIAL

	POSIÇÃO	%
Bens de Consumo	<b>1,718,214.00</b>	<b>16.22%</b>
Cuidados com a Saúde	<b>1,639,989.04</b>	<b>15.48%</b>
Energia	<b>2,265,639.00</b>	<b>21.38%</b>
Finanças e Bancos	<b>1,135,845.00</b>	<b>10.72%</b>
Indústria do Papel	<b>514,059.00</b>	<b>4.85%</b>
Mercado Imobiliário	<b>910,790.40</b>	<b>8.60%</b>
Mineração	<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>
Outros	<b>1,135,743.00</b>	<b>10.72%</b>
Transporte	<b>508,442.00</b>	<b>4.80%</b>

## CONSISTÊNCIA DE RETORNO

	FUNDO	% IBVSP
ACUMULADO ANO	<b>-3.59%</b>	<b>-79.97%</b>
ÚLTIMOS 12 MESES	<b>-15.42%</b>	<b>197.85%</b>
24 MESES	<b>-5.22%</b>	<b>-72.24%</b>
36 MESES	<b>6.99%</b>	<b>78.05%</b>
48 MESES	<b>51.94%</b>	<b>119.82%</b>
DESDE O INÍCIO	<b>705.04%</b>	<b>176.90%</b>



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

**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 do 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 expreso 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.*