

# RIO BRAVO FUNDAMENTAL FIA

Renda Variável



Feb-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  
**Controladoria:** Banco Bradesco S.A  
**Auditor:** KPMG  
**Aplicação Mínima:** R\$ 1.000  
**Saldo mínimo:** R\$ 1.000  
**Aplicação Adicional:** R\$ 1000  
**Valor Mínimo de Resgate:** R\$ 1000  
**Resgate:** Conversão D+12 / Crédito D+2  
**Taxa de Administração:** 0.50% aa.  
**Início do Fundo:** 8 de setembro de 2004  
**Código ANBID:** 215740  
**Classificação:** Fundo de investimento em ações  
**Perfil de Risco:** Arrojado  
**Cota:** Fechamento  
**Dados Bancários:**

Fav: 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 (%)

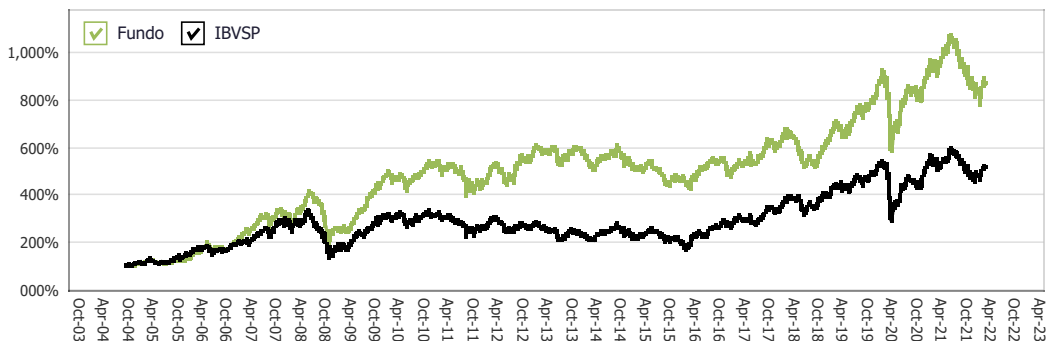
	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
<b>2022</b>													
Fundo	5.01%	-0.27%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	<b>4.73%</b>
IBVSP	6.98%	0.89%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	<b>7.94%</b>
Alpha	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	<b>-3.21%</b>
<b>2021</b>													
Fundo	-2.09%	-1.68%	8.29%	2.10%	6.02%	-1.84%	-4.58%	-3.79%	-3.71%	-6.75%	-2.85%	0.56%	<b>-10.80%</b>
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%	<b>-11.93%</b>
Alpha	1.23%	2.70%	2.29%	0.16%	-	-	-	-	2.86%	-	-	-	<b>1.13%</b>
<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%	<b>7.12%</b>
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%	<b>2.92%</b>
Alpha	2.69%	-	9.01%	-	-	-	-	1.90%	1.35%	-	-	-	<b>4.20%</b>
<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%	<b>34.19%</b>
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%	<b>31.58%</b>
Alpha	-	-	-	1.67%	2.55%	-	3.09%	1.21%	-	-	1.41%	1.44%	<b>2.61%</b>

	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018
Fundo	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%	4.23%
IBVSP	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%	15.03%
Alpha	-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%	-10.80%

## INDICADORES

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	<b>774.44%</b>	VALOR DA COTA DO FUNDO	<b>8.7444</b>
IBVSP DESDE O INÍCIO (%)	<b>415.03%</b>	SHARPE DESDE O INÍCIO	<b>0.23</b>
% IBVSP DESDE O INÍCIO	<b>186.60%</b>	SHARPE 12 MESES	<b>-0.42</b>
PL ATUAL	<b>3,387,106.04</b>	MAX DRAWDOWN (%)	<b>-53.212%</b>
PL MÉDIO 12 MESES	<b>5,191,288.12</b>	VAR PARAMETRICO DIA (% PL)	<b>-1.87%</b>
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	<b>20</b>	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	<b>-2.57%</b>
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	<b>18</b>	STRESS (% PL)	<b>-23.77%</b>

## PERFORMANCE RELATIVA (%)



## ALOCÇÃO SETORIAL

	POSIÇÃO	%
Bens de Consumo	<b>512,633.00</b>	<b>15.13%</b>
Cuidados com a Saúde	<b>630,433.34</b>	<b>18.61%</b>
Energia	<b>721,404.00</b>	<b>21.30%</b>
Finanças e Bancos	<b>321,246.00</b>	<b>9.48%</b>
Indústria do Papel	<b>183,280.00</b>	<b>5.41%</b>
Mercado Imobiliário	<b>259,170.60</b>	<b>7.65%</b>
Mineração	<b>212,244.00</b>	<b>6.27%</b>
Outros	<b>212,980.00</b>	<b>6.29%</b>
Transporte	<b>207,618.00</b>	<b>6.13%</b>

## CONSISTÊNCIA DE RETORNO

	FUNDO	% IBVSP
ACUMULADO ANO	<b>-10.80%</b>	<b>1.13%</b>
ÚLTIMOS 12 MESES	<b>2.06%</b>	<b>-6.61%</b>
24 MESES	<b>17.05%</b>	<b>7.01%</b>
36 MESES	<b>57.71%</b>	<b>16.05%</b>
48 MESES	<b>56.38%</b>	<b>-16.37%</b>
DESDE O INÍCIO	<b>774.44%</b>	<b>186.60%</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 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 expresse 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.

