

# RIO BRAVO FUNDAMENTAL FIA

Renda Variável



Nov-21

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

Contatos  
Investidores  
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\$ 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.

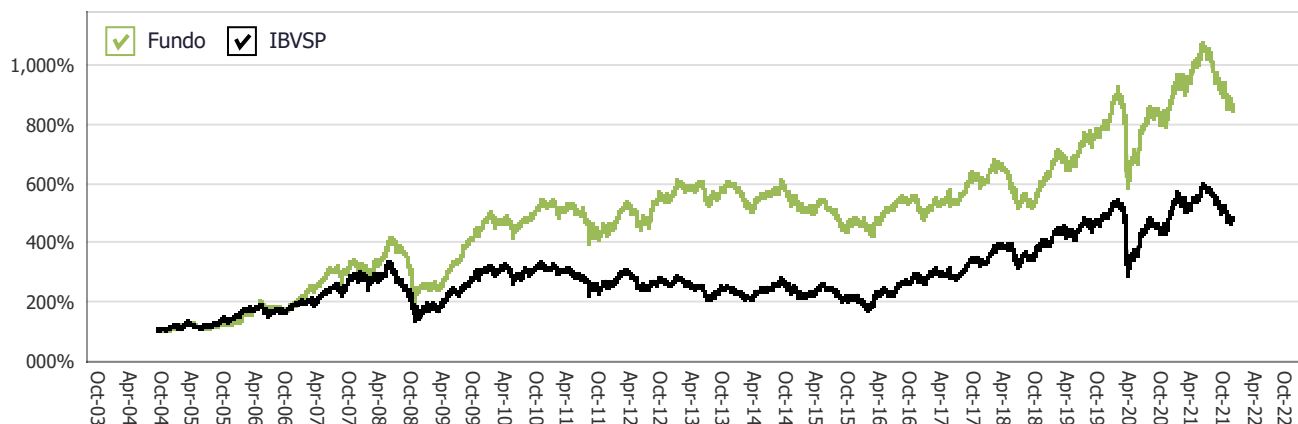
## PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
<b>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%	-	-11.30%
IBVSP	-3.32%	-4.37%	6.00%	1.94%	6.16%	0.46%	-3.94%	-2.48%	-6.57%	-6.74%	-1.53%	-	-14.37%
Alpha	1.23%	2.70%	2.29%	0.16%	-	-	-	-	2.86%	-	-	-	3.07%
<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>													
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%
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%
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%

## INDICADORES

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	<b>730.30%</b>	VALOR DA COTA DO FUNDO	<b>8.3030</b>
IBVSP DESDE O INÍCIO (%)	<b>363.93%</b>	SHARPE DESDE O INÍCIO	<b>0.23</b>
% IBVSP DESDE O INÍCIO	<b>200.67%</b>	SHARPE 12 MESES	<b>-0.39</b>
PL ATUAL	<b>4,510,885.56</b>	MAX DRAWDOWN (%)	<b>-53.212%</b>
PL MÉDIO 12 MESES	<b>5,588,882.00</b>	VAR PARAMETRICO DIA (% PL)	<b>-2.12%</b>
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	<b>20</b>	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	<b>-2.60%</b>
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	<b>18</b>	STRESS (% PL)	<b>-23.98%</b>

## PERFORMANCE RELATIVA (%)



## ALOCÇÃO SETORIAL

	POSIÇÃO	%
Bens de Consumo	<b>972,494.00</b>	<b>21.56%</b>
Cuidados com a Saúde	<b>553,955.00</b>	<b>12.28%</b>
Energia	<b>976,670.00</b>	<b>21.65%</b>
Finanças e Bancos	<b>718,907.00</b>	<b>15.94%</b>
Indústria do Papel	<b>272,118.00</b>	<b>6.03%</b>
Mercado Imobiliário	<b>278,920.00</b>	<b>6.18%</b>
Mineração	<b>286,795.00</b>	<b>6.36%</b>
Outros	<b>152,133.00</b>	<b>3.37%</b>
Transporte	<b>129,255.00</b>	<b>2.87%</b>

## CONSISTÊNCIA DE RETORNO

	FUNDO	% IBVSP
ACUMULADO ANO	<b>-11.30%</b>	<b>3.07%</b>
ÚLTIMOS 12 MESES	<b>-3.09%</b>	<b>-0.98%</b>
24 MESES	<b>11.14%</b>	<b>12.02%</b>
36 MESES	<b>49.75%</b>	<b>22.14%</b>
48 MESES	<b>48.48%</b>	<b>-7.12%</b>
DESDE O INÍCIO	<b>730.30%</b>	<b>200.67%</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.

