

# RIO BRAVO PANDAS FIC FIM

Long & Short



**JUN-19**  
Rio Bravo Investimentos S.A.  
[www.riobravo.com.br](http://www.riobravo.com.br)

**Contatos**  
Investidores Institucionais  
(11) 3509-6639  
[institucionais@riobravo.com.br](mailto:institucionais@riobravo.com.br)  
Investidores Individuais  
(11) 3509-6622  
[invista@riobravo.com.br](mailto:invista@riobravo.com.br)

(11) 3509-6622  
[invista@riobravo.com.br](mailto:invista@riobravo.com.br)

### 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) em compromisso de limites de concentração de fator de risco.

**Público-Alvo**  
Público em geral

### Informações do Produto

**Administrador** • BEM DTVM Ltda. (Grupo Bradesco)  
**Gestor** • Fundamental Investimentos Ltda.  
**Distribuidor** • Rio Bravo DTVM & Guide S.A.  
**Custódia** • Banco Bradesco S.A.  
**Controladoria** • Banco Bradesco S.A.  
**Auditor** • KPMG  
**Aplicação Inicial** • R\$ 20.000  
**Saldo mínimo** • R\$ 20.000  
**Movimentação mínima** • R\$ 5.000  
**Aplicação** • Conversão D+1 d.u.  
**Resgate** • Conversão D+15  
**Taxa de Administração** • 1,10% a.a.  
**Taxa de Performance** • 25% 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 Pandas 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

### PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2019	Fundo	2.89	0.53	0.32	0.88	2.34	-0.46							6.63
	CDI	0.54	0.49	0.47	0.52	0.54	0.47							3.07
	% CDI	532.6	107.6	68.4	169.4	430.3	-98.2							215.8
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	0.47	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	515.4	400.9	-191.5	362.6	367.8	-11.8	224.5	148.3	-260.2	28.3	503.3	204.3
2017	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	1.09	0.86	1.05	0.79	0.93	0.81	0.80	0.80	0.64	0.65	0.57	0.54	9.95
	% CDI	117.1	16.1	9.7	-137.7	173.6	24.1	131.0	36.3	270.3	303.9	212.6	625.7	124.7
Anual		2015	2016											
	Fundo	3.64	9.61											
	CDI	5.06	14.00											
	% CDI	71.9	68.6											

### FUNDO DESDE O INÍCIO (%)

54.03

### CDI DESDE O INÍCIO (%)

44.45

### % CDI DESDE O INÍCIO

121.5

### PL ATUAL

R\$ 4,353,839

### PL MÉDIO 12 MESES

R\$ 3,846,627

### PL MASTER ATUAL

R\$ 9,057,433

### VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)

4.82

### VOLATILIDADE 12 MESES (%)

3.99

### VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)

-0.52

### VAR HISTÓRICO DIA (% PL)

-0.49

### STRESS (% PL)

-2.91

### VALOR DA COTA DO FUNDO

154.027026

### SHARPE DESDE O INÍCIO

0.4

### SHARPE 12 MESES

0.9

### MAX DRAWDOWN (%)

-4.30

### NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO

82

### NÚMERO MESES POSITIVOS

39

### NÚMERO MESES NEGATIVOS

8

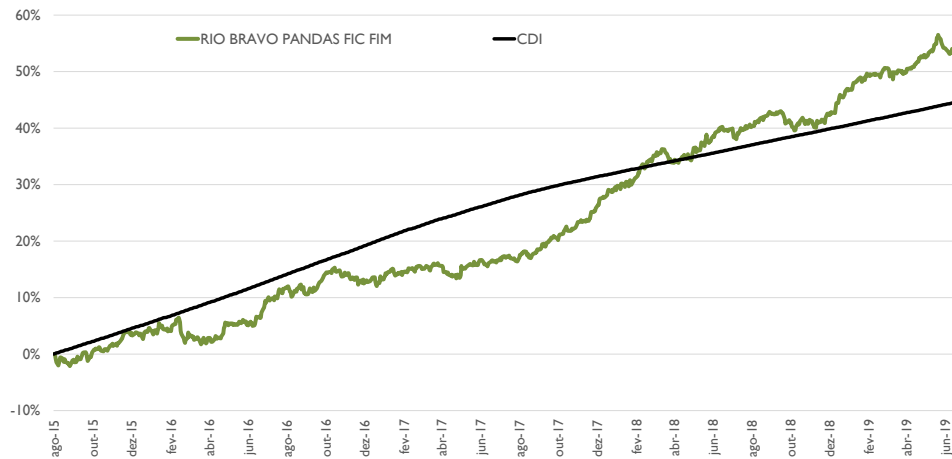
### NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI

26

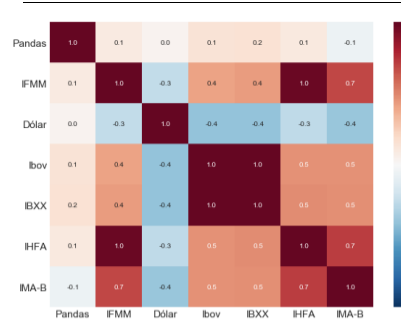
### NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI

21

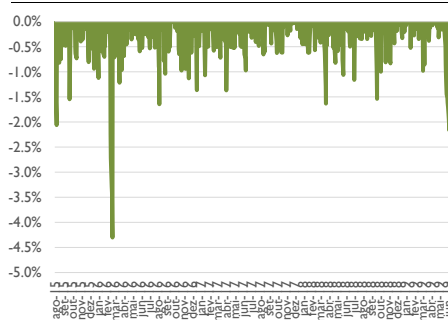
### PERFORMANCE RELATIVA (%)



### 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 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 e inequívoca de 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.