

# RIO BRAVO PANDAS FIC FIM

Long & Short



## PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
MAR-20	Fundo	0.98	0.52	3.58	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5.14
	Rio Bravo Investimentos S.A	0.38	0.29	0.34	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.01
	<a href="http://www.riobravo.com.br">www.riobravo.com.br</a>	259.6	175.3	1052.8	-	-	-	-	-	-	-	-	-	506.0
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	0.47	0.48	0.38	0.38	5.97
	% CDI	532.6	107.6	68.4	169.4	430.3	-98.2	-79.1	-90.6	-346.7	146.9	-87.2	-234.0	57.5
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	0.47	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
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	1.09	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
2017	Fundo													
	CDI													
	% CDI													

	2015	2016
Fundo	3.64	9.61
CDI	5.06	14.00
% CDI	71.9	68.6

**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 • 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.

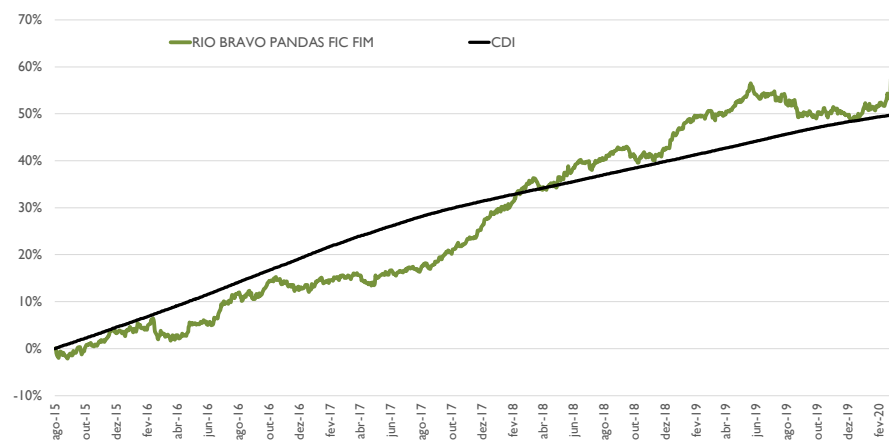
20% em aplicações de 181 a 360 dias.  
17,5% em aplicações de 361 a 720 dias.

15% em aplicações superiores a 720 dias.  
IOF • Os resgates com prazo inferior a

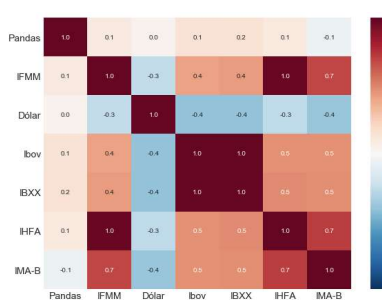
30 (trinta) dias da data de aplicação sofrerão tributação pelo IOF

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	57.08	STRESS (% PL)	-3.63
CDI DESDE O INÍCIO (%)	50.01	VALOR DA COTA DO FUNDO	157.075622
% CDI DESDE O INÍCIO	114.1	SHARPE DESDE O INÍCIO	0.2
PL ATUAL	R\$ 3,443,703	SHARPE 12 MESES	-0.1
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 4,007,323	MAX DRAWDOWN (%)	-4.30
PL MASTER ATUAL	R\$ 5,689,158	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	149
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.06	NÚMERO MESES POSITIVOS	44
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	5.54	NÚMERO MESES NEGATIVOS	12
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.78	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	31
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.26	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	25

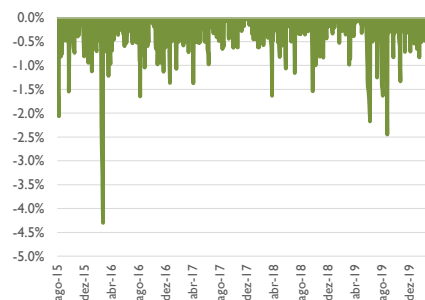
## PERFORMANCE RELATIVA (%)



## 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 inequivocamente 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.