

# RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

## Multi-Assets



### PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2022	Fundo	-1.41	0.21	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-1.21
	CDI	0.73	0.76	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.49
	% CDI	-	27.7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-80.8
2021	Fundo	-0.48	1.49	-0.12	1.49	-1.04	-1.28	1.01	0.79	1.84	1.45	0.88	1.64	7.87
	CDI	0.15	0.13	0.20	0.21	0.27	0.31	0.36	0.43	0.44	0.49	0.59	0.77	4.42
	% CDI	-322.7	1104.2	-61.8	-	-384.1	-416.9	284.3	-	-	-	-	213.8	177.9
2020	Fundo	0.98	0.52	3.58	-0.32	0.60	0.02	0.66	-0.65	-1.22	-0.34	-0.98	1.46	4.29
	CDI	0.38	0.29	0.34	0.28	0.24	0.21	0.19	0.16	0.16	0.16	0.15	0.16	2.76
	% CDI	259.6	175.9	1058.8	-113.5	254.6	-	-	-	-	-217.2	-	-	155.6
2019	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	0.46	0.48	0.38	0.37	5.96
	% CDI	532.6	107.6	68.4	-	430.3	-98.2	-	-90.9	-348.1	-	-87.2	-235.2	57.6
Anual		2015	2016	2017	2018									
	Fundo	3.64	9.61	12.41	13.12									
	CDI	5.06	14.00	9.93	6.42									
	% CDI	71.92	68.62	125.03	204.35									

FEV-22  
Rio Bravo Investimentos S.A.  
[www.riobravo.com.br](http://www.riobravo.com.br)  
Contatos  
Investidores Institucionais  
[ri@riobravo.com.br](mailto:ri@riobravo.com.br)  
[institucionais@riobravo.com.br](mailto:institucionais@riobravo.com.br)  
[www.riobravo.com.br/onde-investir](http://www.riobravo.com.br/onde-investir)

#### 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 • Rio Bravo Investimentos Ltda.  
Distribuidor • Rio Bravo DTVM  
Custódia • Banco Bradesco S.A.  
Controladoria • Banco Bradesco S.A.  
Auditor • Pricewaterhousecoopers  
Aplicação Inicial • R\$ 100,00  
Saldo mínimo • R\$ 100,00  
Movimentação mínima • R\$ 100,00  
Aplicação • Conversão D+0 du  
Resgate • Conversão D+15 Corridos  
Liquidação Financeira • Primeiro dia útil subsequente à Data da Conversão  
Taxa de Administração • 1,50% a.a.  
Taxa de Performance • 20% a.a. excesso 100% CDI

Código ANBIMA • 402362

Classificação • Multimercado Livre

Perfil de Risco • Arrojado

Cota • Fechamento

#### Dados Bancários

Fav.: Rio Bravo Sistemático 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 (%)

66.05

#### CDI DESDE O INÍCIO (%)

61.67

#### % CDI DESDE O INÍCIO

107.1

#### PL ATUAL

R\$ 9,238,871

#### PL MÉDIO 12 MESES

R\$ 11,721,993

#### PL MASTER ATUAL

R\$ 9,120,250

#### VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)

5.26

#### VOLATILIDADE 12 MESES (%)

6.79

#### VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)

-0.71

#### VAR HISTÓRICO DIA (% PL)

-0.77

#### STRESS (% PL)

-12.32

#### VALOR DA COTA DO FUNDO

166.050925

#### SHARPE DESDE O INÍCIO

0.10

#### SHARPE 12 MESES

0.03

#### MAX DRAWDOWN (%)

-4.96

#### NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO

52

#### NÚMERO MESES POSITIVOS

58

#### NÚMERO MESES NEGATIVOS

21

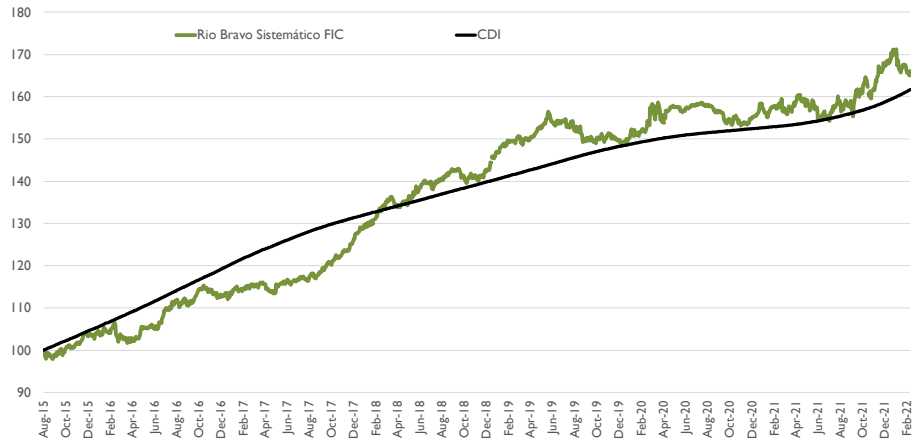
#### NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI

26

#### NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI

45

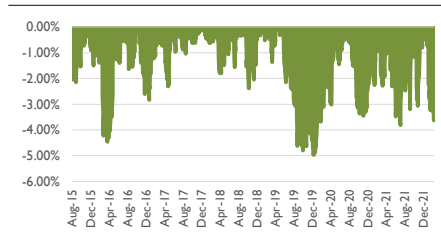
### PERFORMANCE RELATIVA (%)



### 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 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.



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