

RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

Multi-Assets



PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JUN-21	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2021	Fundo	-0.48	1.49	-0.12	1.49	-1.04	-1.28	-	-	-	-	-	-	-	0.01
	CDI	0.15	0.13	0.20	0.21	0.27	0.31	-	-	-	-	-	-	-	1.28
	% CDI	-	1104.2	-	715.6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.6
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	-	254.6	10.3	338.2	-	-	-	-	888.4	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	169.4	430.3	-	-	-	-	147.5	-	-	57.6	
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	0.46	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	516.4	401.6	-	362.6	367.8	-	224.5	148.3	-	28.3	503.3	204.4	
Anual		2015	2016	2017											
	Fundo	3.64	9.61	12.41											
	CDI	5.06	14.00	9.93											
	% CDI	71.92	68.62	125.03											

JUN-21

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

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 & Guide S.A

Custódia • Banco Bradesco S.A

Controladoria • Banco Bradesco S.A

Auditor • KPMG

Aplicação Inicial • R\$ 100,00

Saldo mínimo • R\$ 100,00

Movimentação mínima • R\$ 100,00

Aplicação • Conversão D+0 d.u

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

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 Sistemático FIC FIM

- Banco Bradesco (237) - Ag. 2856 -
C/c 9738-1 - CNPJ 22.407.091/0001-17

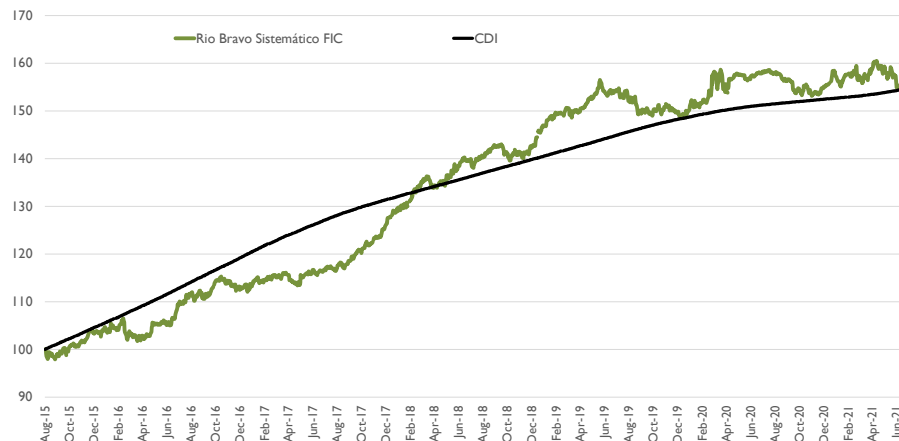
Horário para Solicitação de Resgates e Aplicações • 9h00 às 14h00

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 (%)	55.83	STRESS (% PL)	-5.82
CDI DESDE O INÍCIO (%)	54.50	VALOR DA COTA DO FUNDO	155.825463
% CDI DESDE O INÍCIO	102.4	SHARPE DESDE O INÍCIO	0.05
PL ATUAL	R\$ 12,340,681	SHARPE 12 MESES	-0.69
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 8,909,140	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MASTER ATUAL	R\$ 12,302,050	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.01	NÚMERO MESES POSITIVOS	51
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	4.66	NÚMERO MESES NEGATIVOS	20
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.62	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	36
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.64	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	35

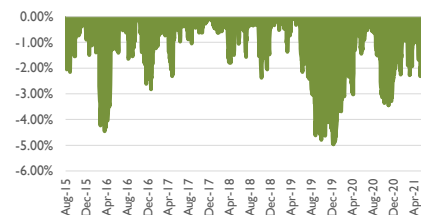
PERFORMANCE RELATIVA (%)



CORRELAÇÕES

Rio Bravo Sistemático	Bovespa	S&P500	IHFA	FIX	Dólar	Ouro	
Rio Bravo Sistemático	1	-0.03	-0.08	-0.02	-0.14	0.11	-0
Bovespa	-0.03	1	0.6	0.76	0.47	-0.38	-0.31
S&P500	-0.08	0.6	1	0.56	0.33	-0.21	-0.17
IHFA	-0.02	0.76	0.56	1	0.48	-0.31	-0.2
FIX	-0.14	0.47	0.33	0.48	1	-0.29	-0.11
Dólar	0.11	-0.38	-0.21	-0.31	-0.29	1	0.38
Ouro	-0	-0.31	-0.17	-0.2	-0.11	0.38	1

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 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 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.