

# RIO BRAVO SISTEMÁTICO FIC FIM

## Multi-Assets

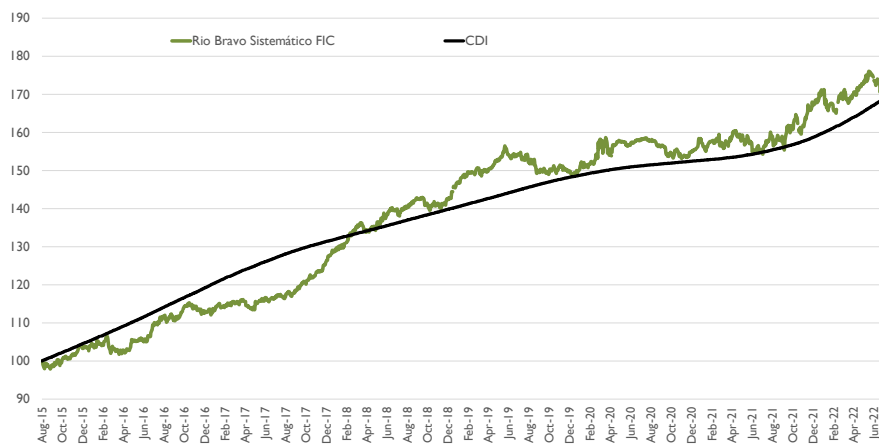


### PERFORMANCE HISTÓRICA (%)

		JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2022	Fundo	-1.41	0.21	1.37	1.86	1.97	-0.87	-0.55	-	-	-	-	-	2.53
	CDI	0.73	0.76	0.93	0.83	1.03	1.02	1.03	-	-	-	-	-	6.51
	% CDI	-	27.7	-	222.7	-	-	-	-	-	-	-	-	38.9
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
Annual		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									

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	72.34	STRESS (% PL)	-3.92
CDI DESDE O INÍCIO (%)	69.66	VALOR DA COTA DO FUNDO	
% CDI DESDE O INÍCIO	103.8	SHARPE DESDE O INÍCIO	0.07
PL ATUAL	R\$ 12,505,772	SHARPE 12 MESES	0.00
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 10,834,872	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MASTER ATUAL	R\$ 12,521,621	NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.28	NÚMERO MESES POSITIVOS	61
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	6.68	NÚMERO MESES NEGATIVOS	23
VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.61	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	27
VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.44	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	45

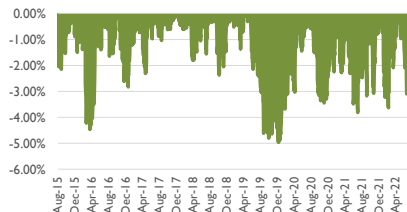
### PERFORMANCE RELATIVA (%)



### CORRELAÇÕES

Correlation - LTM	SISTEMATICO	IBOVESPA	S&P500	IHA	IFIX	DOLAR	OURO
SISTEMATICO	1.0	-0.09	0.04	-0.11	0.02	0.03	0.02
IBOVESPA	-0.09	1.0	0.47	0.74	0.29	-0.35	-0.01
S&P500	0.04	0.47	1.0	0.47	0.19	-0.13	0.02
IHA	-0.11	0.74	0.47	1.0	0.33	-0.29	-0.06
IFIX	0.02	0.29	0.19	0.33	1.0	-0.2	-0.09
DOLAR	0.03	-0.35	-0.13	-0.29	-0.2	1.0	-0.01
OURO	0.02	-0.01	0.02	-0.06	-0.09	-0.01	1.0

### 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 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.

**Objetivo do Fundo**  
O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital, no longo prazo superior à 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.

**Contatos**  
Investidores Institucionais  
ri@riobravo.com.br  
institucionais@riobravo.com.br  
www.riobravo.com.br/onde-investir

**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 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

**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