

Multimercado

Setembro - 2022

Rio Bravo Investimentos S.A.
www.riobravo.com.br

Contatos
Investidores Institucionais
ri@riobravo.com.br
comercial@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.
Gestor • Rio Bravo Investimentos Ltda.
Custódia • Banco Bradesco S.A.
Controladoria • Banco Bradesco S.A.
Auditor • Pricewaterhousecoopers
Aplicação Inicial • R\$ 100
Saldo mínimo • R\$ 100
Aplicação Adicional • R\$ 100
Valor Mínimo de Resgate • R\$ 100
Resgate • Conversão D+15 / Crédito D+1
Taxa de Administração • 1,50% a.a.
Início do Fundo • 6 de agosto de 2015
Código ANBID • 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 em 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

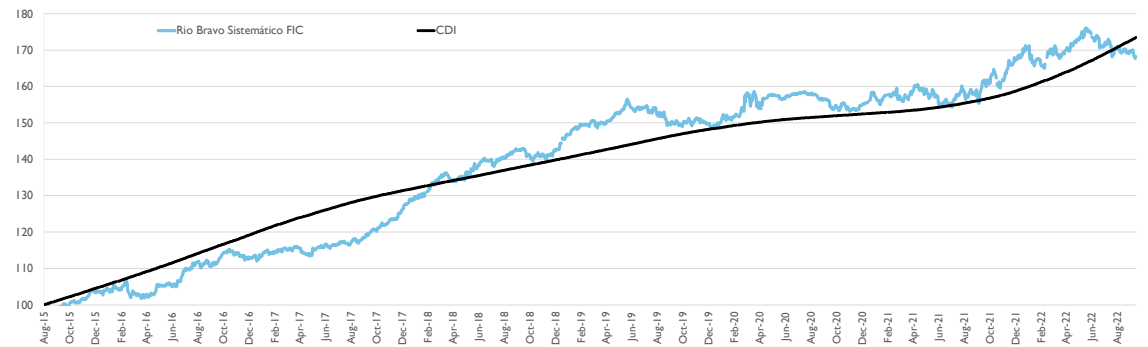
Performance Histórica (%)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2022													
Fundo	-1.41	0.21	1.37	1.86	1.97	-0.87	-0.55	-1.62	-0.79	-	-	-	0.08
CDI	0.73	0.76	0.93	0.83	1.03	1.02	1.03	1.17	1.07	-	-	-	8.91
% CDI	-192.9	27.7	147.7	222.7	190.0	-85.9	-53.6	-138.7	-73.6	-	-	-	0.8
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	715.6	-384.1	-416.9	284.3	184.2	417.4	298.7	150.2	213.8	177.9
2020													
Fundo	0.98	0.52	-	-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	-	0.28	0.24	0.21	0.19	0.16	0.16	0.16	0.15	0.16	2.76
% CDI	259.6	175.9	-	-113.5	254.6	10.3	338.2	-406.1	-776.1	-217.2	-658.7	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	-98.2	-79.1	-90.9	-348.1	147.5	-87.2	-235.2	57.6
Anual													
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									

Indicadores

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	68.20	VALOR DA COTA DO FUNDO	168.203647
CDI DESDE O INÍCIO (%)	73.49	SHARPE ANUALIZADO DESDE O INÍCIO	-0.06
% CDI DESDE O INÍCIO	92.81%	SHARPE 12 MESES	-0.93
PL ATUAL MASTER	R\$ 11,535,338	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 10,919,534	VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.47
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.29%	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.51
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	6.41%	STRESS (% PL)	-3.94
NÚMEROS DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	194	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	44
NÚMERO MESES POSITIVOS	59	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	41
NÚMERO MESES NEGATIVOS	26		

Performance Relativa



Correlação - 60M

	Sistemático	Dolar	Ibovespa	IHFA	IFIX	OURO	S&P 500
Sistemático	1	0.14	-0.31	-0.19	-0.27	0.23	-0.09
Dolar	0.14	1	-0.74	-0.70	-0.45	0.70	-0.36
Ibovespa	-0.31	-0.74	1	0.87	0.65	-0.46	0.54
IHFA	-0.19	-0.70	0.87	1	0.66	-0.39	0.43
IFIX	-0.27	-0.45	0.65	0.66	1	-0.24	0.32
OURO	0.23	0.70	-0.46	-0.39	-0.24	1	-0.17
S&P 500	-0.09	-0.36	0.54	0.43	0.32	-0.17	1

Max Drawdown

