

Rio Bravo Sistemático FIC FIM



22.407.091/0001-17

Multimercado

Outubro - 2022

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

Gestor • Rio Bravo Investimentos Ltda.
Administrador • BEM DTVM Ltda.
Aplicação Inicial • R\$ 100
Saldo mínimo • R\$ 100
Aplicação Adicional • R\$ 100
Valor Mínimo de Resgate • R\$ 100
Resgate • Conversão D+1 / Crédito D+1
Taxa de Administração • 1,50% a.a.
Código ANBID • 402362
Código Bloomberg • PNDSPFC BZ Equity
Código ISIN • BRPND2CTF003

Informações Adicionais

Classificação • Multimercado livre
Início do Fundo • 6 de agosto de 2015
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

Contatos

ri@riobravo.com.br
comercial@riobravo.com.br
www.riobravo.com.br/onde-investir

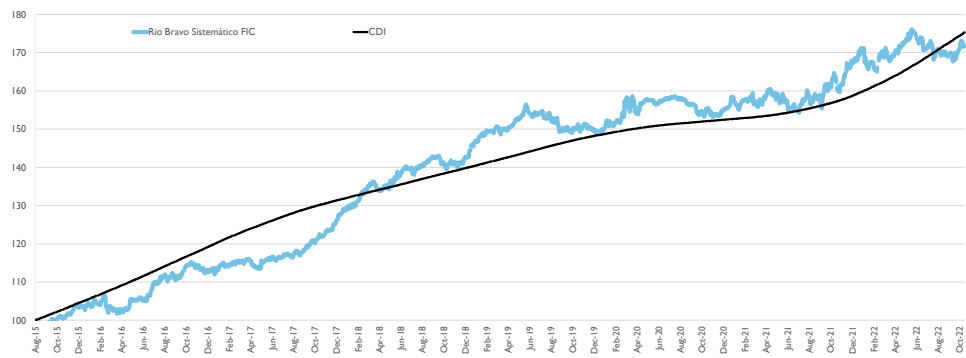
Performance Histórica (%)

	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	2.06	-	-	2.14
CDI	0.73	0.76	0.93	0.83	1.03	1.02	1.03	1.17	1.07	1.02	-	-	10.02
% CDI	-192.9	27.7	147.7	222.7	190.0	-85.9	-53.6	-138.7	-73.6	201.9	-	-	21.3
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	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	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 (%)	71.67	VALOR DA COTA DO FUNDO	171.669603
CDI DESDE O INÍCIO (%)	75.26	SHARPE ANUALIZADO DESDE O INÍCIO	-0.03
% CDI DESDE O INÍCIO	95.23%	SHARPE 12 MESES	-0.94
PL ATUAL MASTER	R\$ 6,780,040	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 10,709,417	VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.31%	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.49
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	6.30%	STRESS (% PL)	-3.85
NÚMEROS DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	194	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	45
NÚMERO MESES POSITIVOS	60	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	41
NÚMERO MESES NEGATIVOS	26		

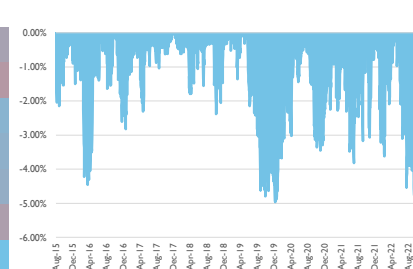
Performance Relativa



Correlação - 60M

	Sistemático	Dolar	Ibovespa	IHFA	IFIX	OURO	S&P 500
Sistemático	1	0.12	-0.30	-0.18	-0.28	0.21	-0.06
Dolar	0.12	1	-0.74	-0.70	-0.44	0.70	-0.37
Ibovespa	-0.30	-0.74	1	0.87	0.65	-0.46	0.55
IHFA	-0.18	-0.70	0.87	1	0.66	-0.39	0.43
IFIX	-0.28	-0.44	0.65	0.66	1	-0.24	0.31
OURO	0.21	0.70	-0.46	-0.39	-0.24	1	-0.19
S&P 500	-0.06	-0.37	0.55	0.43	0.31	-0.19	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 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 e 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 individualizado de propriedade única e exclusiva da Rio Bravo, bem como quaisquer informações, relações, 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 redistribuição 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 aos devedores sanções legais. • As informações aqui contidas 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 disponibilizadas.