

Rio Bravo Sistemático FIC FIM

22.407.091/0001-17

Multimercado

Dezembro - 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

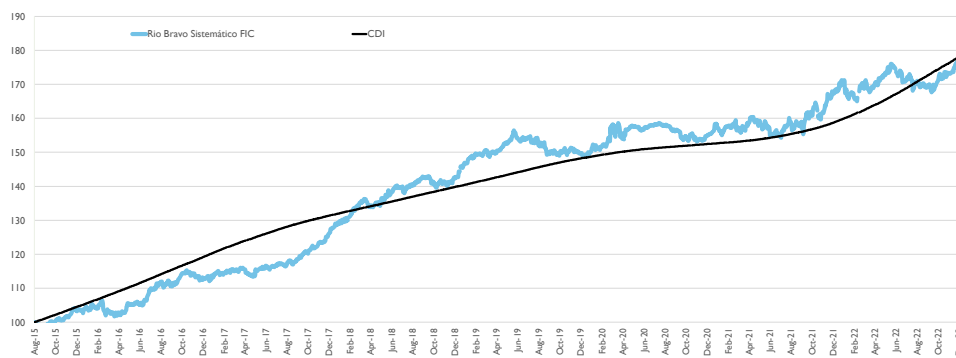
Performance Histórica (%)

	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	1.15	0.70	4.03
CDI	0.73	0.76	0.93	0.83	1.03	1.02	1.03	1.17	1.07	1.02	1.02	1.12	12.39
% CDI	-192.9	27.7	147.7	222.7	190.0	-85.9	-53.6	-138.7	-73.6	201.9	112.5	62.1	32.5
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 (%)	74.85	VALOR DA COTA DO FUNDO	174.851029
CDI DESDE O INÍCIO (%)	79.03	SHARPE ANUALIZADO DESDE O INÍCIO	-0.04
% CDI DESDE O INÍCIO	94.71%	SHARPE 12 MESES	-1.24
PL ATUAL MASTER	R\$ 6,780,040	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 9,983,096	VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.52
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.30%	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.40
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	5.88%	STRESS (% PL)	-2.28
NÚMEROS DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	194	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	46
NÚMERO MESES POSITIVOS	62	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	42
NÚMERO MESES NEGATIVOS	26		

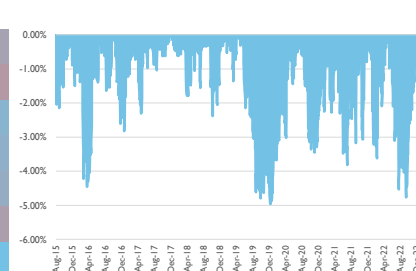
Performance Relativa



Correlação - 60M

	Sistemático	Dolar	Ibovespa	IHFA	IFIX	OURO	S&P 500
Sistemático	1	0.12	-0.34	-0.20	-0.29	0.22	-0.07
Dolar	0.12	1	-0.75	-0.70	-0.44	0.69	-0.35
Ibovespa	-0.34	-0.75	1	0.86	0.65	-0.48	0.54
IHFA	-0.20	-0.70	0.86	1	0.67	-0.41	0.41
IFIX	-0.29	-0.44	0.65	0.67	1	-0.25	0.29
OURO	0.22	0.69	-0.48	-0.41	-0.25	1	-0.18
S&P 500	-0.07	-0.35	0.54	0.41	0.29	-0.18	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. 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, 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 permitida qualquer tipo de transmissão, cópia ou subseqüente sem o expresso escrito consentimento da Rio Bravo, sob pena de se tratar de infração aos direitos de propriedade da Rio Bravo, acarretando as devidas 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.