

Rio Bravo Sistemático FIC FIM



22.407.091/0001-17

Multimercado

Janeiro - 2023

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+15 / Crédito D+1

Taxa de Administração • 1,50% a.a.

Código ANBID • 402362

Código Bloomberg • PND5FIC B2 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

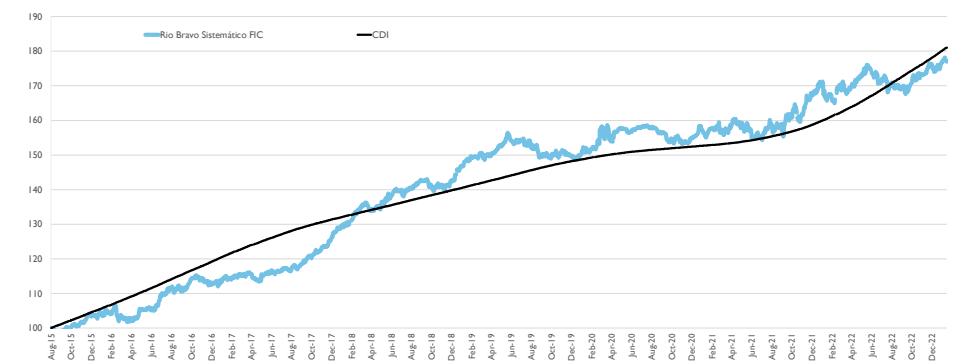
Performance Histórica (%)

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO
2023													
Fundo	1.25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.25
CDI	1.12	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.12
% CDI	110.9	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	110.9
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
Annual	2015	2016	2017	2018	2019								
Fundo	3.64	9.61	12.41	13.12	3.43								
CDI	5.06	14.00	9.93	6.42	5.96								
% CDI	71.92	68.62	125.03	204.35	57.61								

Indicadores

FUNDO DESDE O INÍCIO (%)	77.03	VALOR DA COTA DO FUNDO	177.028326
CDI DESDE O INÍCIO (%)	81.04	SHARPE ANUALIZADO DESDE O INÍCIO	-0.03
% CDI DESDE O INÍCIO	95.04%	SHARPE 12 MESES	-0.96
PL ATUAL MASTER	R\$ 6,410,128	MAX DRAWDOWN (%)	-4.96
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 9,568,749	VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0.37
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5.29%	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0.44
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	5.39%	STRESS (% PL)	-2.05
NÚMERO DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	194	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	47
NÚMERO MESES POSITIVOS	63	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	42
NÚMERO MESES NEGATIVOS	26		

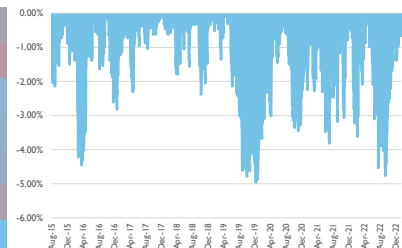
Performance Relativa



Correlação - 60M

	Sistemático	Dolar	Ibovespa	IHFA	IFIX	OURO	S&P 500
Sistemático	1	0.14	-0.37	-0.24	-0.31	0.23	-0.08
Dolar	0.14	1	-0.74	-0.69	-0.42	0.69	-0.35
Ibovespa	-0.37	-0.74	1	0.86	0.65	-0.48	0.53
IHFA	-0.24	-0.69	0.86	1	0.66	-0.42	0.39
IFIX	-0.31	-0.42	0.65	0.66	1	-0.25	0.27
OURO	0.23	0.69	-0.48	-0.42	-0.25	1	-0.18
S&P 500	-0.08	-0.35	0.53	0.39	0.27	-0.18	1

Max Drawdown



A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

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 investimento. • 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 deste documento. • Todo o material aqui contido, incluindo os textos, gráficos, imagens e qualquer outro material de comunicação audiovisual são de propriedade íntima e exclusiva da Rio Bravo, bem como quaisquer informações, relatórios, produtos e serviços, que constam em qualquer material produzido pela 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 crime a 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 disponíveis.