

Multimercado

RIO BRAVO

Sistemático FIC FIM

22.407.091/0001-17

Fundo multimercado quantitativo que busca oportunidades em diversos ativos através do uso da inteligência artificial.

Lançado em 2015, o **Rio Bravo Sistemático** busca unir uma criteriosa abordagem fundamentalista com tecnologia de ponta. Seu principal característica é a **descorrelação** com os principais índices de mercado e com a maioria dos fundos da indústria, consolidando seu perfil defensivo em cenários de alta volatilidade.

Rio Bravo Investimentos
www.riobravo.com.br
Contatos
ri@riobravo.com.br
comercial@riobravo.com.br
www.riobravo.com.br

Objetivo do Fundo
O fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital superior a rentabilidade do 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 derivativos, sem compromisso de limites de concentração de fator de risco.

CNPJ
22.407.091/0001-17
Público-Alvo
Público em geral

Informações do Produto Gestor

Rio Bravo Investimentos
Administrador
BEM DTVM Ltda.
(Grupo Bradesco)

Aplicação Inicial
R\$ 100,00

Saldo Mínimo
R\$ 100,00

Aplicação Adicional
R\$ 100,00

Valor Mínimo para Resgate
R\$ 100,00

Resgate
Conversão D+15 / Crédito D+1

Taxa de Administração
1,50% a.a.

Código ANBIMA
402362

ISIN
BRPND2CTF003
Código Bloomberg
PNDSFIC BZ Equity

Informações Adicionais

Classificação
Multimercado Livre

Início do fundo
17/08/2015

Cota
Fechamento

Dados Bancários
Banco Bradesco (237)
Ag. 2856 - C/C 9738-1

Horário para Solicitação de Resgates e Aplicações
9h00 às 14h00

Imposto de Renda
Retido semestralmente em maio e novembro, alíquota de:

22,5% em aplicações até 180 dias.

20% em aplicações de 181 a 360 dias.

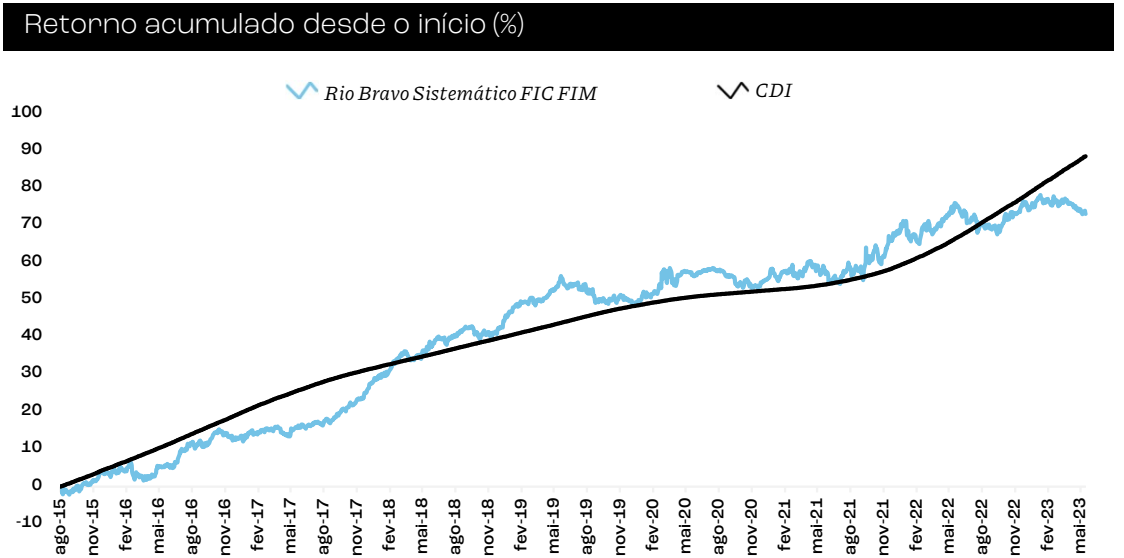
17,5% em aplicações de 361 a 720 dias.

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 (%)													
2023													
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
Fundo	1,25	-0,97	0,47	-0,72	-0,99	-	-	-	-	-	-	-	-0,98
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	-	-	-	-	-	-	-	5,37
%CDI	110,85	-105,44	39,94	-78,80	-88,03	-	-	-	-	-	-	-	-18,30
2022													
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
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	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	1,07	1,02	1,02	1,12	12,37
%CDI	-192,86	27,95	148,25	222,71	190,65	-86,07	-53,60	-138,90	-73,57	201,88	112,47	62,07	32,57
Anual													
	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021						
Fundo	3,64	9,61	12,41	13,12	3,43	4,29	7,87						
CDI	5,06	14,00	9,95	6,42	5,97	2,77	4,40						
%CDI	71,92	68,61	124,70	204,29	57,53	155,05	179,07						

*Fundo lançado em 17/08/2015



Fonte: Quantum Axis e Rio bravo

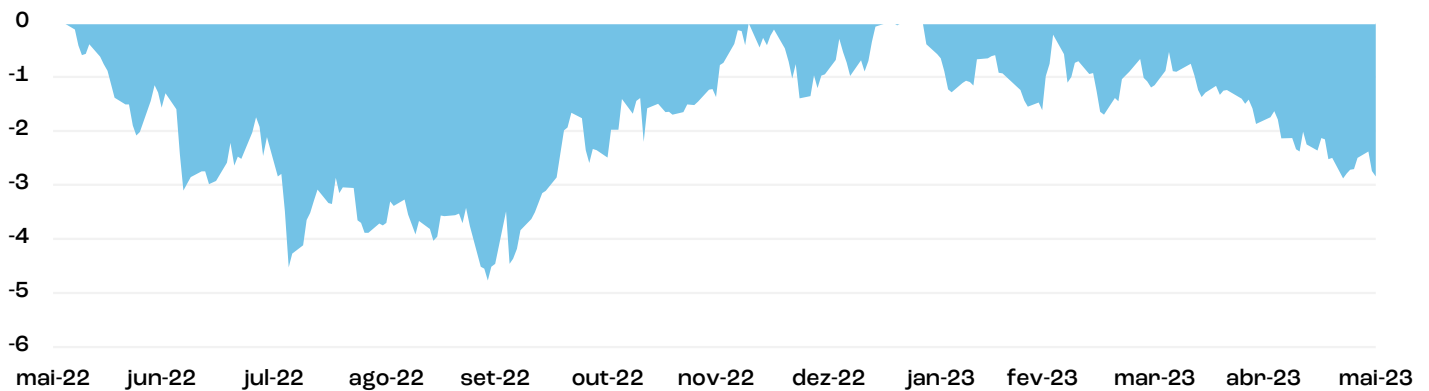
Performance histórica			
Fundo desde o início (%)	73,13	PL médio 12 meses	R\$ 8.658.885,65
CDI desde o início (%)	88,65	Volatilidade 12 meses (%)	4,84
%CDI desde o início	82,50	Sharpe 12 meses	-2,71
PL Atual	R\$ 6.339.449,88	Max Drawdown (%)	-4,77
Valor da cota do fundo	R\$ 173,133437		

Matriz de correlação (12 meses)

	Fundo	Dólar	Ibov	IFIX	IHFA	Ouro	S&P 500
Fundo	1,00	-0,10	0,13	0,05	0,18	-0,03	-0,14
Dólar	-0,10	1,00	-0,43	-0,23	-0,44	0,40	0,50
Ibov	0,13	-0,43	1,00	0,24	0,63	-0,33	-0,01
IFIX	0,05	-0,23	0,24	1,00	0,27	-0,16	-0,11
IHFA	0,18	-0,44	0,63	0,27	1,00	-0,40	-0,30
Ouro	-0,03	0,40	-0,33	-0,16	-0,40	1,00	0,30
S&P 500	-0,14	0,50	-0,01	-0,11	-0,30	0,30	1,00

Fonte: Quantum Axis e Rio Bravo

Máximo drawdown % (12 meses)



Fatores do fundo

O fundo possui estratégias long short baseadas em 5 fatores. São estratégias em que cada etapa do processo de análise e execução é pautada por regras elaboradas pela gestão e executadas de forma automatizada. Tais modelos ajudam a regular as exposições do fundo conforme os movimentos de mercado.

Valor

Ativos baratos tendem a performar melhor que ativos caros.

Momentum

A performance recente de um ativo tende a continuar num futuro próximo.

Carry

Ativos com alto yield tendem a ter retornos mais altos que ativos com yield baixo.

Defensivo

Ativos de menor risco tendem a gerar melhores retornos ajustados ao risco.

Volume

Ativos com menor liquidez tem maiores retornos esperados.



**Seu
investimento
tem poder.**

riobravo.com.br comercial@riobravo.com.br (11) 3509-6500

Recomendações ao Investidor: Este material foi elaborado pela Rio Bravo Investimentos Ltda. ("Rio Bravo Investimentos" ou "Rio Bravo"), inscrita no CNPJ sob nº. 03.864.607/0001-08, e não deve ser considerado um relatório de análise para fins. Este material tem caráter meramente informativo, não constitui e nem deve ser interpretado como sendo material promocional, solicitação de compra ou venda, oferta ou recomendação de qualquer ativo financeiro, investimento, sugestão e alocação ou adoção de estratégias por parte dos destinatários. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto, lâmina de informações essenciais e do regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. As informações contidas nesse material foram consideradas razoáveis na data em que ele foi divulgado e foram obtidas de fontes públicas consideradas confiáveis. A Rio Bravo Investimentos não dá nenhuma segurança ou garantia, seja de forma expressa ou implícita, sobre a integridade, confiabilidade ou exatidão dessas informações. Para avaliação da performance de fundo(s) de investimento(s), é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Performance passada não é garantia de ganhos futuros. Os investimentos em fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou pelo Fundo Garantidor de Crédito. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. A Rio Bravo Investimentos não se responsabiliza por quaisquer decisões tomadas tendo como base os dados neste documento. A Rio Bravo Investimento não é responsável por qualquer utilização não autorizada do material e das informações aqui dispostas. Informações entre em contato com o nosso SAC/ Ouvidoria: 0800 722 9910 | ouvidoria@riobravo.com.br.

 Autorregulação
ANBIMA

Gestão de Recursos