

## 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

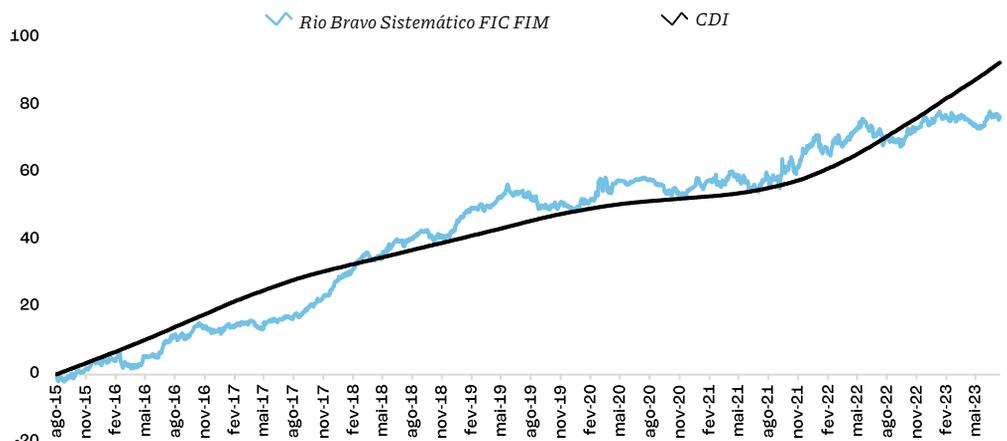
sofrerão tributação pelo IOF.

## Performance histórica (%)

2023													
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
<b>Fundo</b>	1,25	-0,97	0,47	-0,72	-0,99	2,92	-0,84	-	-	-	-	-	1,04
<b>CDI</b>	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	-	-	-	-	-	7,64
<b>%CDI</b>	110,85	-105,44	39,94	-78,80	-88,03	271,93	-78,81	-	-	-	-	-	13,65
2022													
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
<b>Fundo</b>	-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
<b>CDI</b>	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
<b>%CDI</b>	-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						
<b>Fundo</b>	3,64	9,61	12,41	13,12	3,43	4,29	7,87						
<b>CDI</b>	5,06	14,00	9,95	6,42	5,97	2,77	4,40						
<b>%CDI</b>	71,92	68,61	124,70	204,29	57,53	155,05	179,07						

\*Fundo lançado em 17/08/2015

## Retorno acumulado desde o início (%)



Fonte: Quantum Axis e Rio bravo

## Performance histórica

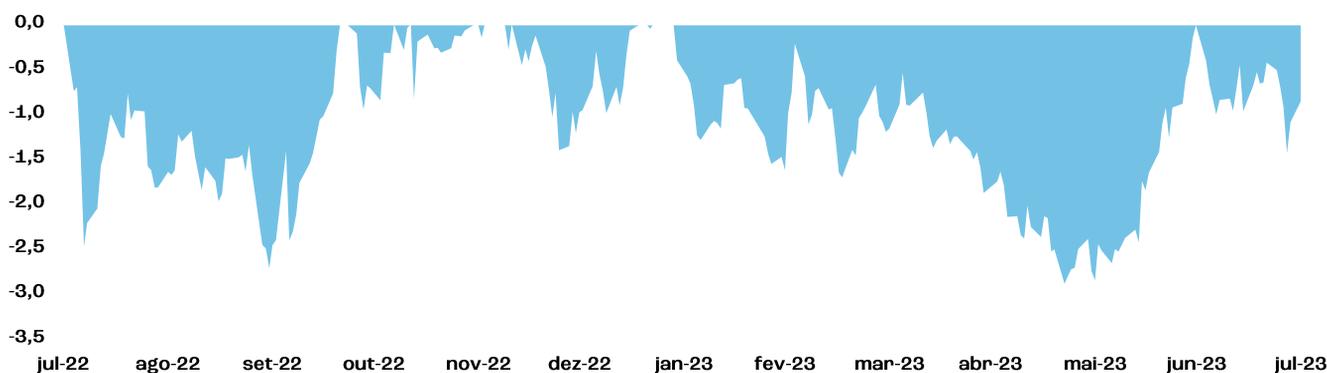
Fundo desde o início (%)	76,68	PL médio 12 meses	R\$7.607.910,92
CDI desde o início (%)	92,72	Volatilidade 12 meses (%)	4,68
%CDI desde o início	82,70	Sharpe 12 meses	-2,10
PL Atual	R\$ 6.118.733,90	Max Drawdown (%)	-2,88
Valor da cota do fundo	R\$ 176,675136		

## Matriz de correlação (12 meses)

	Fundo	Dólar	Ibov	IFIX	IHFA	Ouro	S&P 500
Fundo	1,00	-0,08	0,15	0,06	0,23	-0,07	-0,14
Dólar	-0,08	1,00	-0,42	-0,20	-0,42	0,39	0,54
Ibov	0,15	-0,42	1,00	0,22	0,63	-0,36	-0,09
IFIX	0,06	-0,20	0,22	1,00	0,23	-0,15	-0,14
IHFA	0,23	-0,42	0,63	0,23	1,00	-0,40	-0,34
Ouro	-0,07	0,39	-0,36	-0,15	-0,40	1,00	0,35
S&P 500	-0,14	0,54	-0,09	-0,14	-0,34	0,35	1,00

Fonte: Quantum Axis e Rio Bravo

## Máximo drawdown % (12 meses)



## Fatores do fundo

O fundo possui estratégias long short baseadas nos 5 fatores abaixo. 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](http://riobravo.com.br) [comercial@riobravo.com.br](mailto: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 garantida 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