

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

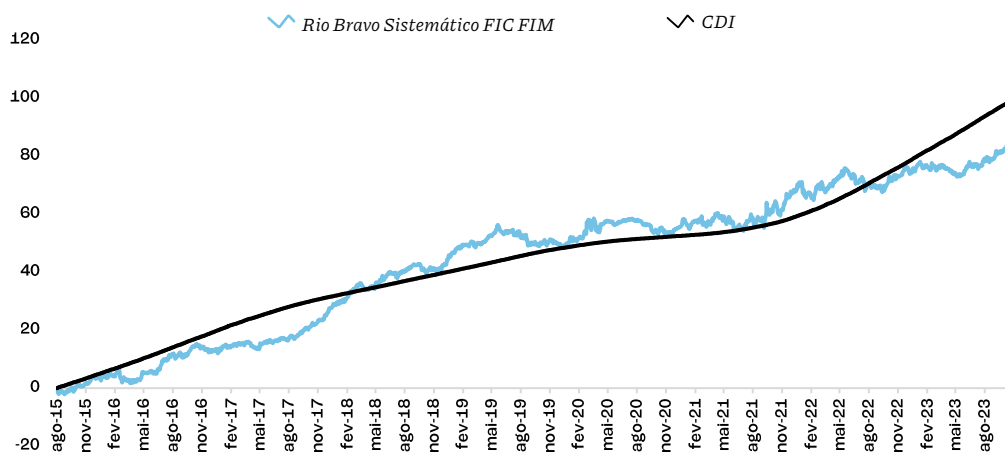
Os resgates com prazo inferior a 30 (trinta) dias da data de aplicação sofrerão tributação pelo IOF.

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	2,92	-0,84	0,74	1,95	0,90	-	-	4,70
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	-	-	11,02
%CDI	110,85	-105,44	39,94	-78,80	-88,03	271,93	-78,81	64,60	200,11	90,00	-	-	42,67
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

Retorno acumulado desde o início (%)



Fonte: Quantum Axis e Rio bravo

Performance histórica

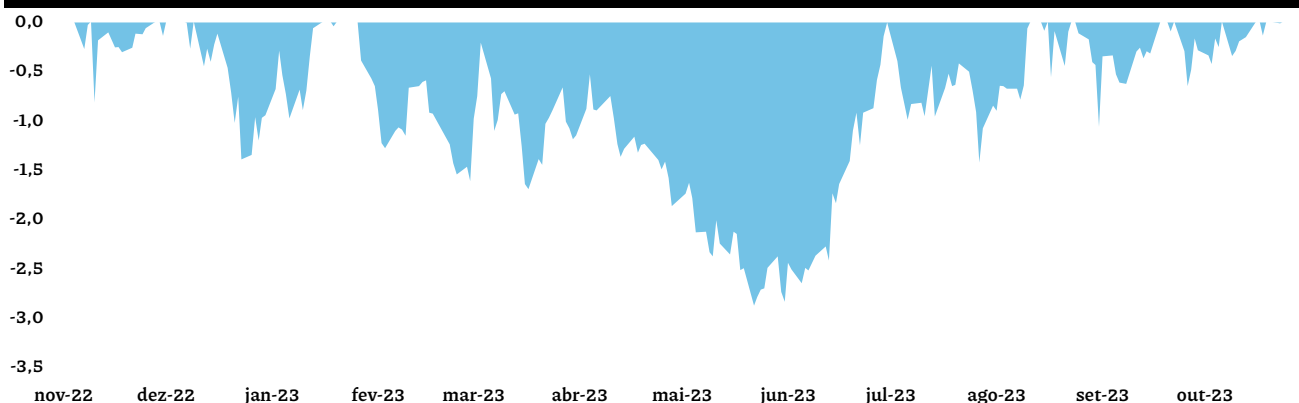
Fundo desde o início (%)	83,08	PL médio 12 meses	R\$6.398.727,52
CDI desde o início (%)	98,77	Volatilidade 12 meses (%)	4,20
%CDI desde o início	84,11	Sharpe 12 meses	-1,49
PL Atual	R\$ 5.957.128,63	Max Drawdown (%)	-2,88
Valor da cota do fundo	R\$ 183,075753		

Matriz de correlação (12 meses)

	Fundo	Dólar	Ibov	IFIX	IHFA	Ouro	S&P 500
Fundo	1,00	-0,08	0,11	0,03	0,22	-0,11	-0,13
Dólar	-0,08	1,00	-0,33	-0,27	-0,39	0,37	0,58
Ibov	0,11	-0,33	1,00	0,19	0,62	-0,39	-0,09
IFIX	0,03	-0,27	0,19	1,00	0,21	-0,12	-0,15
IHFA	0,22	-0,39	0,62	0,21	1,00	-0,33	-0,26
Ouro	-0,11	0,37	-0,39	-0,12	-0,33	1,00	0,31
S&P 500	-0,13	0,58	-0,09	-0,15	-0,26	0,31	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 ✉ 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