

## 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

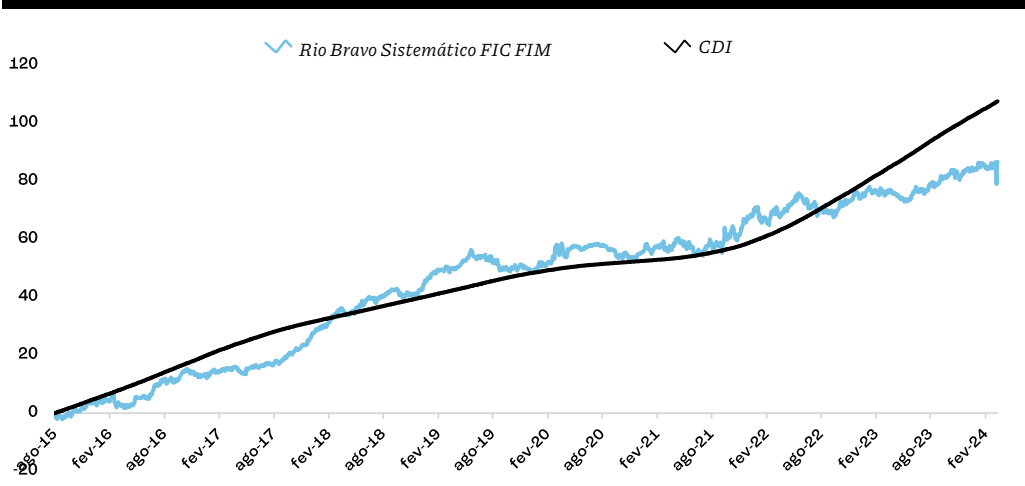
sofrerão tributação pelo IOF.

## Performance histórica (%)

2024													
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
Fundo	0,82	-0,25	1,07	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,75
CDI	0,97	0,80	0,83	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,62
%CDI	95,23	-30,55	128,48	-	-	-	-	-	-	-	-	-	66,72
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	-0,48	0,81	5,05
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	13,05
%CDI	110,85	-105,44	39,94	-78,80	-88,03	271,93	-78,81	64,60	200,11	90,00	-52,15	90,72	38,71
Anual													
	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022					
Fundo	3,64	9,61	12,41	13,12	3,43	4,29	7,87	4,03					
CDI	5,06	14,00	9,95	6,42	5,97	2,77	4,40	12,37					
%CDI	71,92	68,61	124,70	204,29	57,53	155,05	179,07	32,57					

\*Fundo lançado em 17/08/2015

## Retorno acumulado desde o início (%)



Fonte: Quantum Axis e Rio bravo

## Performance histórica

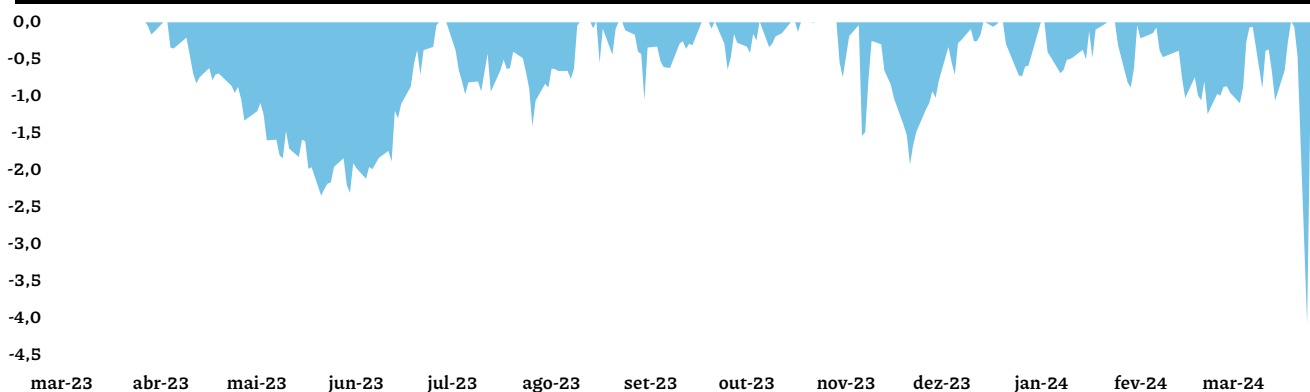
Fundo desde o início (%)	86,90	PL médio 12 meses	R\$5.864.185,13
CDI desde o início (%)	107,71	Volatilidade 12 meses (%)	6,62
%CDI desde o início	80,68	Sharpe 12 meses	-0,91
PL Atual	R\$ 4.914.765,43	Max Drawdown (%)	-4,09
Valor da cota do fundo	R\$ 186,897945		

## Matriz de correlação (12 meses)

	Fundo	Dólar	Ibov	IFIX	IHFA	Ouro	S&P 500
Fundo	1,00	-0,01	0,12	-0,02	0,12	0,04	0,02
Dólar	-0,01	1,00	-0,39	-0,11	-0,40	0,20	0,52
Ibov	0,12	-0,39	1,00	0,12	0,69	-0,21	0,10
IFIX	-0,02	-0,11	0,12	1,00	0,12	0,03	-0,01
IHFA	0,12	-0,40	0,69	0,12	1,00	-0,09	0,00
Ouro	0,04	0,20	-0,21	0,03	-0,09	1,00	0,01
S&P 500	0,02	0,52	0,10	-0,01	0,00	0,01	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