

# Rio Bravo Sistemático FIC FIM



## Multimercado

fevereiro23

**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 BZ 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
<b>2023</b>													
Fundo	1,25	-0,97	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,27
CDI	1,12	0,92	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,05
% CDI	110,9	-105,4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12,9
<b>2022</b>													
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
<b>2021</b>													
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
<b>2020</b>													
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
<b>Anual</b>													
	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 (%)	75,31	VALOR DA COTA DO FUNDO	175,314509
CDI DESDE O INÍCIO (%)	82,71	SHARPE ANUALIZADO DESDE O INÍCIO	-0,08
% CDI DESDE O INÍCIO	91,06%	SHARPE 12 MESES	-1,22
PL ATUAL	R\$ 6.524.950	MAX DRAWDOWN (%)	-4,89
PL MÉDIO 12 MESES	R\$ 9.306.514	VAR PARAMÉTRICO DIA (% PL)	-0,41
VOLATILIDADE DESDE O INÍCIO (%)	5,27%	VAR HISTÓRICO DIA (% PL)	-0,36
VOLATILIDADE 12 MESES (%)	5,32%	STRESS (% PL)	-1,39
NÚMEROS DIAS ÚTEIS DE RECUPERAÇÃO	194	NÚMERO MESES ACIMA 100% CDI	47
NÚMERO MESES POSITIVOS	63	NÚMERO MESES ABAIXO 100% CDI	43
NÚMERO MESES NEGATIVOS	27		

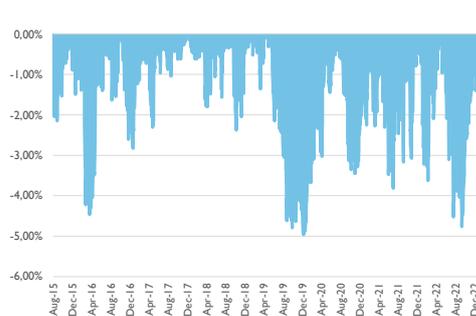
### Performance Relativa



### Correlação - 60M

	Sistemático	Dolar	Ibovespa	IHFA	IFIX	OURO	S&P 500
Sistemático	1	0,12	-0,35	-0,23	-0,32	0,23	-0,04
Dolar	0,12	1	-0,74	-0,69	-0,43	0,68	-0,35
Ibovespa	-0,35	-0,74	1	0,86	0,64	-0,46	0,54
IHFA	-0,23	-0,69	0,86	1	0,66	-0,41	0,40
IFIX	-0,32	-0,43	0,64	0,66	1	-0,25	0,28
OURO	0,23	0,68	-0,46	-0,41	-0,25	1	-0,17
S&P 500	-0,04	-0,35	0,54	0,40	0,28	-0,17	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 aquisição de cotas dos fundos de investimentos. • 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 garante 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 neste documento. • Todo o material aqui contido, incluindo os textos, gráficos, imagens e qualquer outro material de comunicação audiovisual não é propriedade única e exclusiva da Rio Bravo, bem como quaisquer informações, relativas, produtos e serviços, que conjuntamente compõem valiosa propriedade intelectual da Rio Bravo. • O material aqui veiculado deve ser entendido como de uso pessoal. • Não é permitido qualquer tipo de transmissão, cópia ou adulteração sem o expresso escrito consentimento da Rio Bravo, sob pena de se tratar clara 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 dispostas.