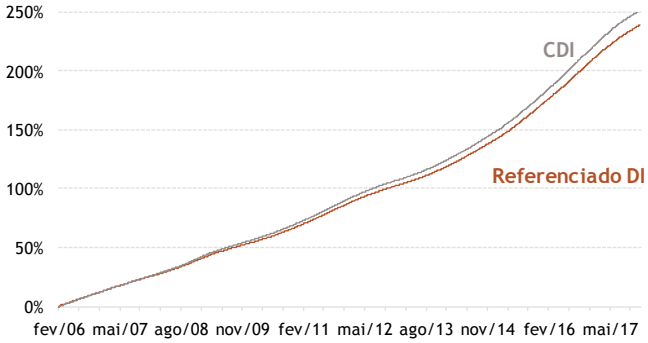
# Bahia AM FI RF Referenciado DI

Dezembro | 2017

## OBJETIVO/ESTRATÉGIA

O fundo tem como objetivo proporcionar aos seus cotistas a rentabilidade média dos Certificados de Depósito Interfinanceiro - CDI, por meio da atuação preponderante em títulos públicos ou privados e operações nos mercados de derivativos.

## RENTABILIDADE ACUMULADA




## RENTABILIDADE

| MENSAL | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **2017** | **1,05%** | **0,84%** | **1,02%** | **0,77%** | **0,90%** | **0,82%** | **0,78%** | **0,77%** | **0,62%** | **0,62%** | **0,54%** | **0,51%** |
| CDI | 1,09% | 0,87% | 1,05% | 0,79% | 0,93% | 0,81% | 0,80% | 0,80% | 0,64% | 0,65% | 0,57% | 0,54% |
| **2016** | **1,05%** | **0,94%** | **1,12%** | **1,02%** | **1,07%** | **1,13%** | **1,08%** | **1,17%** | **1,06%** | **1,01%** | **1,01%** | **1,08%** |
| CDI | 1,05% | 1,00% | 1,16% | 1,05% | 1,11% | 1,16% | 1,11% | 1,21% | 1,11% | 1,05% | 1,04% | 1,12% |
| **2015** | **0,91%** | **0,80%** | **1,02%** | **0,91%** | **0,97%** | **1,03%** | **1,15%** | **1,08%** | **1,11%** | **1,07%** | **1,02%** | **1,14%** |
| CDI | 0,93% | 0,82% | 1,03% | 0,95% | 0,98% | 1,06% | 1,18% | 1,11% | 1,11% | 1,11% | 1,06% | 1,16% |

| ANUAL | FUNDO | CDI | %CDI |
|---|---|---|---|
| **2017** | 9,6% | 10,0% | 97% |
| **2016** | 13,5% | 14,0% | 96% |
| **2015** | 12,9% | 13,2% | 98% |
| **2014** | 10,5% | 10,8% | 97% |
| **2013** | 7,8% | 8,1% | 97% |
| **2012** | 8,2% | 8,4% | 97% |

## ESTATÍSTICAS

| | | DESDE INÍCIO | 12 MESES | 24 MESES |
|---|---|---|---|---|
| **Retorno** | Fundo | 238,7% | 9,8% | 24,7% |
| | CDI | 251,4% | 10,1% | 25,6% |
| | %CDI | 95% | 97% | 96% |
| **Retorno Anualizado** | Fundo (a.a.) | 10,9% | 9,8% | 11,7% |
| | CDI (a.a.) | 11,2% | 10,1% | 12,1% |
| | %CDI (a.a.) | 97% | 97% | 97% |
| **Volatilidade** | | 0,1% | 0,0% | 0,0% |
| **Sharpe** | | - | - | - |
| **Meses acima CDI** | | 5 | 1 | 1 |
| **Meses abaixo CDI** | | 137 | 11 | 23 |
| **Maior retorno mensal** | | 1,3% | 1,1% | 1,2% |
| **Menor retorno mensal** | | 0,5% | 0,5% | 0,5% |

## CARACTERÍSTICAS GERAIS

| | |
|---|---|
| **Público-alvo** | Investidores em geral |
| **Início** | 13/02/2006 |
| **PL Atual** | R$ 138.448.676 |
| **PL Médio (12 m)** | R$ 135.449.587 |
| **Investimento Inicial Mínimo** | R$ 50.000 |
| **Movimentação Mínima** | R$ 10.000 |
| **Saldo Mínimo** | R$ 20.000 |
| **Investimento Inicial Mínimo / Saldo Mínimo (Conta e ordem)** | R$ 20.000 |
| **Aplicação** | D+0 |
| **Resgate (conversão de cotas)** | D+0 |
| **Resgate (pagamento)** | D+0 |

| | |
|---|---|
| **Tx Adm[3] / Máxima[4]** | 0,3% a.a / 0,35% a.a. |
| **Tx Performance** | Não há. |
| **Tipo ANBIMA** | Renda Fixa - Duração Baixa - Grau de Investimento |
| **Administrador** | BEM DTVM Ltda. |
| **Gestora[1]** | Bahia AM Renda Fixa Ltda. |
| **Escala de Risco do Administrador** | - + |

## DADOS BANCÁRIOS

Favorecido: Bahia AM FI RF Referenciado DI
CNPJ: 07.812.369/0001-48
Banco: Banco Bradesco S.A. - 237
Agência: 2856 | Conta Corrente: 4488-1
Horário de movimentação: Até as 14h30



ANBIMA A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO
1 A Bahia AM Renda Fixa Ltda. não comercializa nem distribui cotas de fundos de investimento ou qualquer outro ativo financeiro. 2 Considerando a taxa de administração mínima do fundo e a máxima dos fundos investidos. | O fundo pode estar exposto à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. Este fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de suas políticas de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Este fundo busca manter uma carteira de ativos com prazo médio superior a 365 dias. Alterações nestas características podem levar a um aumento do IR incidente sobre a rentabilidade auferida pelo investidor. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA DISPONÍVEL NO FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES. Mais informações do fundo (objetivo, categoria, gestor, rentabilidade dos últimos anos e outras), acesse www.bahiaasset.com.br. Administradora: BEM DTVM Ltda., CNPJ: 00.066.670/0001-00, Cidade de Deus, Prédio Prata, 4º andar, Vila Yara, Osasco-SP, CEP 06029-900, Tel: (11) 3684-9432, www.bradescobemdtvm.com.br, SAC: centralbemdtvm@bradesco.com.br ou 0800 704 8383, Ouvidoria: 0800 727 9933. Para Lâmina de Informações Essenciais, Regulamento, lista de distribuidores e demais documentos do fundo, acesse www.bradescobemdtvm.com.br.