

OBJETIVO/ESTRATÉGIA

O fundo tem como objetivo proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital no longo prazo através da aplicação no Bahia AM Long Biased Master FIM, que por sua vez investe seus recursos, primordialmente, no mercado de renda variável, podendo realizar ainda investimentos nos mercados de renda fixa, cambial e derivativos (inclusive em posições vendidas). O Long Biased poderá, através do fundo investido, manter até 20% dos seus recursos em ativos financeiros negociados no exterior.

RENTABILIDADE ACUMULADA

RENTABILIDADE

MENSAL	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANUAL	FUNDO	IPCA+6%	DIF.
2018	7,11%	3,35%	0,44%										2018	11,2%	2,2%	9,0%
IPCA + 6%	0,81%	0,73%	0,63%										2017	22,1%	9,0%	13,0%
2017	5,35%	3,18%	-0,75%	1,01%	-3,57%	-0,06%	5,20%	4,97%	4,94%	0,14%	-4,05%	4,38%	2016	22,9%	12,7%	10,2%
IPCA + 6%	0,89%	0,75%	0,79%	0,56%	0,82%	0,28%	0,71%	0,73%	0,62%	0,90%	0,75%	0,90%				
2016	2,46%	1,90%	1,40%	3,49%	-4,95%	2,60%	7,58%	1,06%	0,73%	8,42%	-2,24%	-0,92%				
IPCA + 6%	1,74%	1,39%	0,91%	1,07%	1,26%	0,88%	1,00%	0,98%	0,58%	0,72%	0,65%	0,81%				

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE

Setor	Atribuição		Exposição		
	mar/18	2018	mar/18		
			Long	Short	Líquida
Bancos	0,50%	5,12%	18,2%	0,0%	18,2%
Commodities	-0,43%	2,96%	22,8%	-0,8%	22,0%
Consumo Básico	-0,19%	-0,49%	0,3%	-4,1%	-3,8%
Consumo Discricionário	0,11%	0,86%	10,7%	-0,9%	9,8%
Educação	0,10%	0,16%	2,3%	0,0%	2,3%
Energia (Oleo e Gás)	-0,03%	3,38%	12,5%	-0,4%	12,2%
Imobiliário e Shoppings	0,13%	0,13%	1,1%	-0,6%	0,5%
Indústria e Transporte	0,47%	1,90%	12,8%	-0,3%	12,4%
Outros Serviços	0,00%	0,00%	0,0%	0,0%	0,0%
Seguradoras e Saúde	0,07%	0,24%	0,5%	-1,8%	-1,3%
Serviços Financeiros	0,19%	0,06%	0,0%	-2,9%	-2,9%
Telecomunicações	0,08%	0,10%	1,8%	-1,3%	0,5%
Utilities	-0,24%	0,30%	2,2%	-0,9%	1,3%
Índice	-0,33%	-1,19%	0,7%	0,0%	0,7%
Total	0,40%	13,54%	86,0%	-14,1%	71,9%
Caixa / Txs / Custos	0,03%	-2,36%			
Long Biased	0,44%	11,17%			
Diferencial IPCA+6%	-0,19%	8,98%			

ESTATÍSTICAS

		DESDE INÍCIO	12 MESES	24 MESES
Retorno	Fundo	66,8%	27,6%	57,2%
	IPCA + 6%	25,6%	8,9%	20,7%
	Diferencial IPCA + 6%	41,2%	18,7%	36,5%
Retorno Anualizado	Fundo (a.a.)	25,7%	27,6%	25,4%
	IPCA + 6% (a.a.)	10,8%	8,9%	9,9%
Tracking Error ⁵		13,1%	13,2%	13,4%
	Diferencial IPCA + 6%(a.a.)	15,0%	18,7%	15,5%
Information Ratio ⁶		1,0	1,3	1,0
Meses acima IPCA + 6%		18	7	16
Meses abaixo IPCA + 6%		9	5	8
Maior retorno mensal (Diferencial IPCA + 6%)		7,7%	6,3%	7,7%
Menor retorno mensal (Diferencial IPCA + 6%)		-6,2%	-4,8%	-6,2%

CARACTERÍSTICAS GERAIS

Público-alvo	Investidores em geral	Tx Saída antecipada²	10% sobre valor resgatado
Início	30/12/2015	Tx Adm³ / Máxima⁴	2,0% a.a / 2,2% a.a.
PL Atual	R\$ 131.757.383	Tx Performance	20% do que exceder o IPCA + 6%
PL Médio (12 m)	R\$ 104.744.244	Tipo ANBIMA	Multimercado Livre
Investimento Inicial / Saldo Mínimo	R\$ 50.000	Administrador	BEM DTVM Ltda.
Investimento Inicial / Saldo Mínimo (Conta e ordem)	R\$ 20.000	Gestora¹	Bahia AM Renda Variável Ltda.
Movimentação Mínima	R\$ 10.000	Escala de Risco do Administrador	- +
Aplicação	D+1		
Resgate (conversão de cotas)	D+30		
Resgate (pagamento)	D+33		

DADOS BANCÁRIOS

Favorecido:
 Bahia AM Long Biased FIC de FIM
 CNPJ: 23.732.231/0001-95
 Banco: Banco Bradesco S.A. - 237
 Agência: 2856 | Conta Corrente: 11422-7
 Horário de movimentação: Até as 14h30

www.bahiaasset.com.br | Tel: (21) 3733-7277


MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

1 O Bahia AM Renda Variável Ltda. não comercializa nem distribui cotas de fundos de investimento ou qualquer outro ativo financeiro. 2 A taxa de saída será descontada do valor total do resgate no dia da efetivação deste, sendo este valor revertido para o patrimônio do fundo e cobrado somente na hipótese de resgates antecipados, que não observem os prazos de resgate padrão. 3 Considerando as taxas de administração mínimas do fundo e dos fundos investidos. 4 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. Para mais informações sobre o fundo, relacionadas ao objetivo, categoria, gestor, rentabilidade 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.