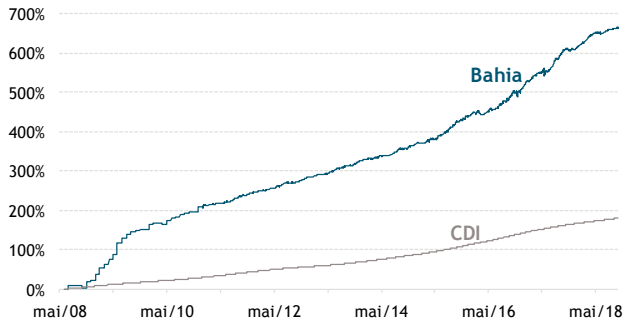
Bahia AM FIC de FIM

Outubro | 2018

OBJETIVO/ESTRATÉGIA

O fundo tem como objetivo proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas, no longo prazo, através da aplicação em cotas de fundos de investimento. Os fundos investidos buscam oportunidades, principalmente, nos mercados de taxa de juros pré e pós-fixadas, índices de preço, moeda estrangeira, renda variável e derivativos diversos. O Bahia poderá, através dos fundos investidos, manter até 20% dos seus recursos em ativos financeiros negociados no exterior.

RENTABILIDADE ACUMULADA[5]



RENTABILIDADE

MENSAL	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
2018	**1,14%**	**1,46%**	**1,40%**	**0,72%**	**-0,08%**	**0,41%**	**0,78%**	**0,33%**	**0,43%**	**0,45%**		
CDI	0,58%	0,47%	0,53%	0,52%	0,52%	0,52%	0,54%	0,57%	0,47%	0,54%		
2017	**1,74%**	**1,63%**	**1,68%**	**0,65%**	**0,30%**	**1,21%**	**3,19%**	**1,34%**	**2,28%**	**0,09%**	**0,07%**	**1,02%**
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	**0,97%**	**0,96%**	**-2,03%**	**1,58%**	**0,67%**	**0,67%**	**2,02%**	**1,22%**	**2,18%**	**1,66%**	**0,96%**	**1,77%**
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%

ANUAL	FUNDO	CDI	%CDI
2018	7,3%	5,4%	135%
2017	16,2%	10,0%	163%
2016	13,3%	14,0%	95%
2015	15,5%	13,2%	118%
2014	10,0%	10,8%	92%
2013	11,1%	8,1%	138%

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE

	out/18	2018	2017
Juros	0,23%	1,76%	6,97%
Moedas	-0,02%	0,25%	-0,35%
Crédito Soberano	0,03%	0,18%	0,66%
Commodities	0,01%	0,06%	-0,17%
Bolsa	-0,14%	2,06%	2,56%
Total Operações	**0,12%**	**4,31%**	**9,67%**
CDI / Txs / Custos	0,33%	2,96%	6,57%
Bahia	**0,45%**	**7,26%**	**16,24%**
%CDI	**83%**	**135%**	**163%**

ESTATÍSTICAS

		DESDE INÍCIO	12 MESES	24 MESES
Retorno	Fundo	667,6%	8,3%	28,0%
	CDI	181,2%	6,6%	18,6%
	%CDI	368%	126%	151%
Retorno Anualizado	Fundo (a.a.)	21,6%	8,3%	13,1%
	CDI (a.a.)	10,4%	6,6%	8,9%
	%CDI (a.a.)	207%	126%	148%
Volatilidade[6]		10,4%	1,8%	3,5%
Sharpe		1,0	0,9	1,1
Meses acima CDI		77	6	15
Meses abaixo CDI		48	6	9
Maior retorno mensal		14,0%	1,5%	3,2%
Menor retorno mensal		-4,4%	-0,1%	-0,1%

CARACTERÍSTICAS GERAIS

Público-alvo	Investidores em geral
Início	30/05/2008
PL Atual / Médio (12 m)	R$ 50,5 mm | R$ 29,5 mm
PL Estratégia[7]	R$ 832 mm
Investimento Inicial / Saldo Mínimo	R$ 50.000
Investimento Inicial / Saldo Mínimo (Conta e ordem)	R$ 20.000
Movimentação Mínima	R$ 10.000
Aplicação	D+0
Resgate (conversão de cotas)	D+20
Resgate (pagamento)	1° dia útil após a conversão

Tx Saída antecipada[2]	10% sobre valor resgatado
Tx Adm[3] / Máxima[4]	2,0% a.a / 2,2% a.a.
Tx Performance	20% do que exceder o CDI
Tipo ANBIMA	Multimercados Macro
Administrador	BEM DTVM Ltda.
Gestoras[1]	Bahia AM Renda Variável Ltda./ Bahia AM Renda Fixa Ltda.
Escala de Risco do Administrador	- +

DADOS BANCÁRIOS

Favorecido: Bahia AM FIC de FIM
CNPJ: 09.528.698/0001-97
Banco: Banco Bradesco S.A. - 237
Agência: 2856 | Conta Corrente: 4553-5
Horário de movimentação: Até as 14h30

www.bahiaasset.com.br | Tel: (21) 3733-7449 / (21) 3733-7277

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

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

1 O Bahia AM Renda Variável Ltda. e o Bahia AM Renda Fixa Ltda. não comercializam nem distribuem 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 cobrada 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 Considerando a taxa de administração mínima do fundo e as máximas dos fundos investidos. 5 Conforme aprovado pelos cotistas, desde o fechamento do dia 30/12/10 o prazo para atualização do valor das cotas foi alterado de mensal para diário. 6 A volatilidade desde o início do fundo é calculada a partir da rentabilidade mensal. 7 O PL Estratégia corresponde à soma dos PLs referentes ao mês atual dos fundos geridos pelas empresas do Bahia Asset, agrupados do Bahia Asset, agrupados pelo mesmo tipo de estratégia. Para conhecer as estratégias e os fundos que as compõem, entre em contato com a área de RI. | Este fundo aplica diretamente e/ou em fundo de investimento (i) autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior, as quais poderão expor a carteira aos riscos correspondentes; (ii) que pode estar exposto à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes e (iii) que utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de suas políticas de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais. 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 cotista. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS E DA TAXA DE SAÍDA. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DOS GESTORES, 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.