

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 (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.
2019	6,11%	-0,69%	1,01%	-0,48%	1,65%	4,14%							2019	12,1%	5,1%	7,0%
IPCA + 6%	0,82%	0,89%	1,18%	1,07%	0,66%	0,42%							2018	21,1%	9,9%	11,2%
2018	7,11%	3,35%	0,44%	2,34%	-5,08%	-0,82%	5,57%	-1,80%	2,10%	4,93%	2,42%	-0,61%	2017	22,1%	9,0%	13,0%
IPCA + 6%	0,81%	0,73%	0,59%	0,70%	0,88%	1,71%	0,89%	0,46%	0,89%	0,97%	0,28%	0,60%				
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%				
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%				

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE

Setor	Atribuição		Exposição		
	jun/19	2019	jun/19		
			Long	Short	Líquida
Bancos	0,52%	3,57%	17,7%	0,0%	17,7%
Commodities	0,91%	0,86%	14,1%	-0,8%	13,3%
Consumo Básico	0,33%	0,63%	6,2%	-3,0%	3,1%
Consumo Discricionário	0,23%	0,06%	5,3%	-0,6%	4,7%
Educação	-0,04%	0,45%	0,6%	-0,4%	0,2%
Energia (Óleo e Gás)	0,34%	1,61%	13,0%	0,0%	13,0%
Imobiliário e Shoppings	1,01%	1,83%	8,2%	-0,1%	8,0%
Indústria e Transporte	0,58%	0,96%	7,2%	-1,3%	5,9%
Outros Serviços	0,08%	0,08%	1,6%	0,0%	1,6%
Seguradoras e Saúde	0,12%	0,94%	4,7%	-0,9%	3,8%
Serviços Financeiros	-0,03%	-0,28%	1,0%	-0,3%	0,7%
Telecomunicações	-0,07%	-0,19%	0,0%	-1,4%	-1,4%
Utilities	0,26%	1,05%	6,8%	-0,4%	6,3%
Índice	0,74%	2,61%	27,2%	-1,5%	25,7%
Total	4,99%	14,17%	113,6%	-10,8%	102,8%
Caixa / Tx / Custos	-0,85%	-2,03%			
Long Biased	4,14%	12,14%			
Diferencial IPCA+6%	3,73%	6,99%			

ESTATÍSTICAS

		DESDE INÍCIO	12 MESES	24 MESES
Retorno	Fundo	103,8%	28,7%	60,4%
	IPCA + 6%	42,1%	9,8%	21,1%
	Diferencial IPCA + 6%	61,7%	18,9%	39,3%
Retorno Anualizado	Fundo (a.a.)	22,8%	28,7%	26,7%
	IPCA + 6% (a.a.)	10,7%	9,8%	10,0%
	Diferencial IPCA + 6%(a.a.)	12,1%	18,9%	16,6%
Volatilidade		13,4%	14,3%	13,2%
Information Ratio ⁵		0,8	1,2	1,2
Meses acima IPCA + 6%		26	7	14
Meses abaixo IPCA + 6%		16	5	10
Maior retorno mensal (Diferencial IPCA + 6%)		7,7%	5,3%	6,3%
Menor retorno mensal (Diferencial IPCA + 6%)		-6,2%	-2,5%	-6,0%

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 (R\$) Atual	R\$ 547,8 mm	Tx Performance	20% do que exceder o IPCA + 6%
PL (R\$) Médio (12 m)	R\$ 323,9 mm	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)	2° dia útil após a conversão		

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 Considerando a taxa de administração mínima do fundo e as máximas dos fundos investidos. 5 Indicador de performance calculado a partir do excesso de retornos diários dividido pelo tracking error do fundo. Este fundo aplica 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. 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, 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: centralbemtvm@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.