

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.
2020	0,10%	-6,16%	-29,98%	8,59%	7,05%	7,39%	9,99%	-2,45%					2020	-11,9%	4,7%	-16,6%
IPCA+6%	0,77%	0,66%	0,59%	0,17%	0,09%	0,72%	0,89%	0,70%					2019	26,4%	10,5%	15,9%
2019	6,11%	-0,69%	1,01%	-0,48%	1,65%	4,14%	0,58%	-0,57%	2,54%	2,45%	0,32%	6,94%	2018	21,1%	9,9%	11,2%
IPCA+6%	0,82%	0,89%	1,18%	1,07%	0,66%	0,46%	0,72%	0,62%	0,45%	0,63%	0,95%	1,61%	2017	22,1%	9,0%	13,0%
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%	2016	22,9%	12,7%	10,2%
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%				

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE


Setor	ago-20	2020	ago/20		
			Long	Short	Líquida
Bancos	0,40%	-6,52%	8,3%	-6,2%	2,1%
Commodities	0,07%	2,62%	25,1%	-5,0%	20,1%
Consumo Básico	-1,08%	-1,88%	8,1%	-2,0%	6,1%
Consumo Discricionário	0,01%	5,11%	22,7%	-0,2%	22,5%
Educação	0,13%	-0,13%	0,5%	-0,6%	-0,1%
Energia (Óleo e Gás)	-0,02%	-3,93%	2,3%	0,0%	2,3%
Imobiliário e Shoppings	-0,67%	-0,74%	10,0%	-0,2%	9,8%
Indústria e Transporte	-0,14%	-2,07%	5,9%	-0,4%	5,5%
Outros Serviços	-0,01%	-0,20%	0,0%	-0,2%	-0,2%
Seguradoras e Saúde	-0,08%	0,22%	6,0%	-1,0%	5,0%
Serviços Financeiros	0,39%	3,45%	11,8%	-0,1%	11,7%
Telecomunicações	-0,15%	-0,08%	1,9%	-0,4%	1,5%
Utilities	-0,88%	0,88%	13,5%	-0,9%	12,6%
Índice	-0,22%	-7,38%	9,2%	-14,0%	-4,8%
Total	-2,25%	-10,66%	125,3%	-31,3%	94,1%
Caixa/ Txs / Custos	-0,20%	-1,24%			
Long Biased	-2,45%	-11,90%			
Diferencial do IPCA+6%	-3,16%	-16,58%			

ESTATÍSTICAS

		DESDE INÍCIO	12 MESES	24 MESES
Retorno	Fundo	102,3%	-0,7%	20,9%
	IPCA+6%	56,4%	8,5%	19,0%
	Diferencial IPCA+6%	46,0%	-9,3%	1,9%
Retorno Anualizado	Fundo (a.a.)	16,4%	-0,7%	10,0%
	IPCA+6% (a.a.)	10,1%	8,5%	9,1%
	Diferencial IPCA+6% (a.a.)	6,3%	-9,3%	0,9%
Volatilidade		22,0%	39,5%	30,0%
Information Ratio ¹		0,4	-	0,2
Meses acima IPCA+6%		33	7	13
Meses abaixo IPCA+6%		23	5	11
Maior retorno mensal (Excesso IPCA+6%)		9,1%	9,1%	9,1%
Menor retorno mensal (Excesso IPCA+6%)		-30,6%	-30,6%	-30,6%

CARACTERÍSTICAS GERAIS

Público-alvo	Investidores em geral
Início	30/12/2015
PL (R\$) Atual Médio (12 m)	R\$ 674,0 mm R\$ 753,1 mm
PL (R\$) Estratégia ²	R\$ 816,9 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+1
Resgate (conversão de cotas)	D+30
Resgate (pagamento)	2° dia útil após a conversão

Tx Saída antecipada ³	10% sobre valor resgatado
Tx Adm ⁴ / Máxima ⁵	2,0% a.a. / 2,2% a.a.
Tx Performance	20% do que exceder o IPCA + 6%
Tipo ANBIMA	Multimercado Livre
Administrador	BEM DTVM Ltda.
Gestora ⁶	Bahia AM Renda Variável Ltda.
Escala de Risco do Administrador	

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

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

1 Indicador de performance calculado a partir do excesso de retornos diários dividido pelo tracking error do fundo. 2 O PL Estratégia corresponde à soma dos PLs referentes ao mês atual dos fundos geridos pelas empresas da Bahia Asset, agrupados da 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. 3 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. 4 Considerando as taxas de administração mínimas do fundo e dos fundos investidos. 5 Considerando a taxa de administração mínima do fundo e as máximas dos fundos investidos. 6 O Bahia AM Renda Variável Ltda. não comercializa nem distribui cotas de fundos de investimento ou qualquer outro ativo financeiro. Este fundo aplica diretamente e/ou em fundo de investimento (i) que poderá estar exposto à significativa concentração em ativos financeiros de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes e (ii) que utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política 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. 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 A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. 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.