

OBJETIVO/ESTRATÉGIA

- Estratégia de renda variável com 13 anos de histórico.
- Busca retorno absoluto no longo prazo por meio de uma carteira diversificada de ações (35 a 45 papéis), selecionadas a partir de intensas análises fundamentalista e dos fluxos, além de eventos de mercado.
- Adequado às EFPC e aos RPPS.

RENTABILIDADE ACUMULADA

RENTABILIDADE

| MENSAL | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | ANUAL | SMLL | DIF. |
|--------|---------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|--------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|--------|
| 2008 | | | | | | -4,04% | -1,23% | -8,60% | -19,85% | -24,13% | 4,96% | 9,27% | -39,59% | -55,31% | 15,7% |
| 2009 | 5,16% | -0,41% | 6,57% | 31,87% | 19,05% | 2,46% | 17,81% | 7,67% | 8,44% | 1,82% | 13,34% | 7,29% | 205,75% | 137,73% | 68,0% |
| 2010 | -0,08% | 2,34% | -0,62% | -0,36% | -2,47% | 2,10% | 10,77% | -1,22% | 5,47% | 7,53% | -0,44% | 3,27% | 28,66% | 22,78% | 5,9% |
| 2011 | -3,85% | 0,32% | 4,25% | 0,83% | 0,65% | -2,02% | -4,58% | -1,82% | -2,20% | 7,90% | 0,40% | 0,93% | 0,17% | -16,61% | 16,8% |
| 2012 | 6,77% | 6,34% | 3,27% | 1,63% | -4,05% | 0,50% | 2,00% | 5,40% | 2,21% | 1,81% | 0,97% | 5,01% | 36,30% | 28,67% | 7,6% |
| 2013 | 1,42% | 0,92% | -2,02% | 0,67% | -0,77% | -5,19% | 2,27% | 2,06% | 2,26% | 3,18% | 0,57% | -0,93% | 4,23% | -15,22% | 19,5% |
| 2014 | -7,12% | -0,10% | 3,01% | 2,54% | 1,63% | 3,17% | 1,81% | 8,55% | -7,47% | 3,31% | 1,73% | -6,73% | 3,02% | -16,96% | 20,0% |
| 2015 | -10,28% | 6,15% | 2,56% | 4,46% | -1,94% | 0,07% | -2,72% | -7,09% | -1,28% | 0,97% | 1,63% | -2,52% | -10,62% | -22,36% | 11,7% |
| 2016 | -5,01% | 4,15% | 5,84% | 5,57% | -6,33% | 3,22% | 11,93% | 0,22% | 0,44% | 11,10% | -6,03% | -1,30% | 24,07% | 31,75% | -7,7% |
| 2017 | 10,17% | 5,71% | -2,07% | 1,19% | -5,02% | -0,42% | 7,84% | 8,10% | 7,10% | -1,12% | -5,41% | 6,36% | 35,56% | 49,36% | -13,8% |
| 2018 | 9,26% | 3,26% | 0,94% | 1,82% | -10,48% | -3,65% | 6,27% | -3,79% | 1,19% | 8,50% | 4,64% | 0,13% | 17,63% | 8,13% | 9,5% |
| 2019 | 10,52% | -2,80% | -0,90% | 0,48% | 2,54% | 6,82% | 2,68% | 0,79% | 2,41% | 2,15% | 2,13% | 11,32% | 44,19% | 58,20% | -14,0% |
| 2020 | 0,79% | -8,06% | -32,70% | 11,65% | 8,04% | 7,66% | 12,44% | -1,72% | -4,69% | 0,99% | 12,00% | 8,26% | 4,47% | -0,65% | 5,1% |
| 2021 | -1,82% | -0,07% | 1,95% | 7,45% | 0,64% | -1,72% | -3,49% | -6,07% | -6,47% | -14,34% | -2,87% | 0,33% | -24,76% | -16,20% | -8,6% |
| 2022 | 4,67% | -2,40% | 6,18% | -9,16% | 0,30% | | | | | | | | -1,17% | -4,02% | 2,8% |

ESTATÍSTICAS

| | | DESDE O INÍCIO | 12 MESES |
|--------------------|-------------------------|----------------|----------|
| Retorno | Fundo | 590,0% | -31,3% |
| | SMLL | 105,8% | -26,9% |
| | Diferencial SMLL | 484,2% | -4,4% |
| Retorno Anualizado | Fundo (a.a.) | 14,8% | -31,3% |
| | SMLL (a.a.) | 5,3% | -26,9% |
| | Diferencial SMLL (a.a.) | 9,5% | -4,4% |
| Tracking Error | | 9,4% | 9,3% |

ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE

| | 12 MESES | MAI/22 |
|-----------------------------|---------------|-------------|
| Índice | 2,2% | 0,4% |
| Energia (Óleo e Gás) | 0,3% | 0,1% |
| Utilities | 0,2% | 0,2% |
| Telecomunicações | 0,0% | 0,0% |
| Educação | 0,0% | 0,0% |
| Consumo Básico | -0,5% | 0,1% |
| Serviços Financeiros | -0,9% | -0,1% |
| Outros Setores/Taxas/Custos | -32,6% | -0,4% |
| Smid Caps Valor | -31,3% | 0,3% |

CARACTERÍSTICAS GERAIS

| | | | |
|---|------------------------------|---|---|
| Público-alvo | Investidores em geral | Tx Saída antecipada ⁴ | 10% sobre valor resgatado |
| Início | 30/05/2008 | Tx Adm ⁵ / Máxima ⁶ | 2,0% a.a / 2,2% a.a. |
| PL (R\$) Atual / Médio (12 m) | R\$ 126,5 mm R\$ 208,4 mm | Tx Performance | 20% do que exceder o SMLL |
| PL (R\$) Estratégia ³ | R\$ 267,1 mm | Tipo ANBIMA | Ações Livre |
| Investimento Inicial / Saldo Mínimo | R\$ 20.000 | Administrador | BEM DTVM Ltda. |
| Investimento Inicial / Saldo Mínimo (Conta e Ordem) | R\$ 1.000 | Gestoras ⁷ | Bahia AM Renda Variável Ltda. |
| Movimentação Mínima | R\$ 1.000 | Dados bancários | Favorecido: Bahia AM Smid Caps Valor FIC de FIA CNPJ: 08.892.340/0001-86 Banco: 237 Agência: 2856 Conta Corrente: 4512-8 Horário de movimentação: Até as 14h30 |
| Aplicação | D+1 | | |
| Resgate (conversão de cotas) | D+60 | | |
| Resgate (pagamento) | 2° dia útil após a conversão | | |

www.bahiaasset.com.br

MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

1 Tracking Error mede o desvio do fundo em relação ao seu benchmark, sendo calculado a partir do desvio-padrão da diferença do retorno do fundo para o retorno do benchmark. 2 Indicador de performance calculado a partir do excesso de retornos diários dividido pelo tracking error do fundo. 3 O PL Estratégia corresponde à soma dos PLs referentes ao mês atual dos fundos geridos pelas empresas da 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. 4 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 master e cobrado somente na hipótese de resgates antecipados, que não observem os prazos de resgate padrão. 5 Considerando as taxas de administração mínimas do fundo e dos fundos investidos. 6 Considerando a taxa de administração mínima do fundo e as máximas dos fundos investidos. 7 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 pode estar exposto à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes e (ii) que utilizam estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. 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. 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.