

Informações Sobre o Fundo

O objetivo do FUNDO é obter rendimentos superiores à variação do CDI em qualquer período de 12 meses. O FUNDO buscará atingir seu objetivo através de estratégias de investimento baseadas em oportunidades originadas por movimentos de curto prazo nos preços dos ativos.

Categoria ANBIMA: Multimercado - Trading

Público Alvo: Investidores em Geral

Data de Início: 24/05/2006

Aplicação Inicial: R\$ 10.000,00

Movimentação Mínima: R\$ 1.000,00

Saldo de Permanência: R\$ 5.000,00

Aplicação Inicial / Saldo de Permanência (Conta e ordem): R\$ 1.000,00

Taxa Mínima de Administração: 1,8% aa

Taxa Máxima de Administração: 2,0% aa

Prêmio de Performance: 20% sobre o que exceder 100% do CDI-CETIP

Classificação Tributária: Longo Prazo

Administrador: BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. DTMV

Custodiante: BANCO BTG PACTUAL S.A.

Imposto de Renda: Alíquota regressiva de 22,5% a 15% sobre o ganho nominal de acordo com o prazo da aplicação

Taxa de Saída: Não há

Carência: Não há

Aplicação: até 14:30hs – D+0

Resgate: até 14:30hs – D+0, recursos disponíveis em D+1

Conta para Aplicação: Banco BTG Pactual (208)

Agência 0001 / Conta 821546-7

Favorecido: Rio Arbitragem FIM

CNPJ: 07.967.080/0001-06

Rentabilidade Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	CDI	% CDI
2006	-	-	-	-	1,88%	2,13%	1,13%	1,51%	0,37%	2,11%	1,47%	1,37%	12,60%	8,32%	151,46%
2007	1,42%	0,19%	1,08%	1,23%	1,31%	1,13%	1,52%	1,03%	1,04%	0,91%	0,58%	0,18%	12,26%	11,82%	103,68%
2008	-1,10%	1,73%	0,44%	0,80%	0,79%	0,92%	0,81%	0,41%	0,79%	0,77%	0,92%	1,93%	9,57%	12,38%	77,32%
2009	1,13%	1,21%	1,33%	2,16%	1,57%	1,13%	1,33%	0,82%	1,37%	0,83%	0,65%	0,98%	15,50%	9,88%	156,98%
2010	0,97%	0,66%	0,73%	0,59%	0,59%	0,46%	0,94%	0,78%	1,29%	0,80%	0,84%	1,02%	10,11%	9,75%	103,66%
2011	0,90%	1,04%	0,86%	0,79%	0,93%	0,90%	0,48%	0,73%	1,27%	0,86%	0,58%	0,81%	10,62%	11,60%	91,60%
2012	1,15%	0,91%	0,79%	0,26%	0,45%	-0,27%	0,52%	0,06%	0,41%	0,86%	-0,38%	1,28%	6,18%	8,40%	73,60%
2013	-0,36%	-0,02%	0,39%	0,24%	0,72%	0,04%	0,10%	1,48%	1,17%	2,75%	0,92%	1,23%	8,97%	8,06%	111,28%
2014	1,39%	0,54%	0,43%	1,31%	1,16%	0,88%	0,67%	0,59%	1,20%	1,98%	0,96%	0,67%	12,41%	10,81%	114,78%
2015	0,57%	1,02%	0,75%	1,09%	0,99%	1,26%	1,15%	1,15%	1,56%	1,11%	0,61%	0,77%	12,73%	13,24%	96,17%
2016	0,24%	1,09%	0,61%	0,86%	1,57%	1,72%	1,79%	1,34%	1,88%	1,58%	0,86%	0,90%	15,41%	14,00%	110,06%
2017	1,28%	0,92%	0,41%	0,64%	1,12%	0,84%	0,58%	0,97%	0,78%	1,01%	-0,91%	0,66%	8,62%	9,93%	86,83%
2018	0,04%	0,88%	-0,46%	1,91%	-0,47%	0,94%	1,31%	-0,14%	0,33%	0,17%	-0,21%	0,43%	4,79%	6,42%	74,59%
2019	2,60%	-0,06%	1,17%	0,59%	0,39%	0,73%	3,16%	0,38%	0,39%	0,47%	-0,28%	0,93%	10,94%	5,96%	183,42%
2020	0,32%	0,61%	0,87%	0,40%	0,45%	0,74%	1,52%	-0,35%	-0,33%	-0,15%	0,88%	0,71%	5,71%	2,76%	207,01%
2021	0,42%	0,30%	0,00%	0,79%	0,59%	0,52%	-0,37%	0,69%	-0,90%	-1,15%	0,47%	0,52%	1,86%	4,43%	42,01%
2022	0,60%	0,19%	1,25%	-1,78%	0,65%	-2,21%	2,05%	2,94%	0,59%	0,77%	-1,19%	0,45%	4,26%	12,39%	34,40%
2023	2,05%	-1,88%	-0,87%	0,86%	3,87%	3,13%	2,55%	-0,49%	0,84%	0,63%	3,06%	1,83%	16,55%	13,04%	126,90%
2024	-2,16%	0,27%	-0,23%	-0,69%	0,67%	0,01%	1,52%	1,67%	-0,93%	-0,19%	-4,00%	-0,67%	-4,77%	10,87%	-
2025	3,61%	0,11%	2,43%	4,50%	1,56%	0,22%	-1,46%	4,76%	1,58%	-0,29%	-0,15%	0,01%	17,99%	14,31%	125,71%
2026	1,41%	0,53%	-0,03%	-1,22%									0,66%	4,54%	14,61%

A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos.

Rentabilidade acumulada nos últimos 12 meses	6,99%	14,83%	47,11%
Rentabilidade acumulada desde o início do fundo	516,20%	587,33%	87,89%

Indicadores Estatísticos - desde o início do fundo

	Rio Arbitragem FIM	CDI
Estatística Descritiva		
Retorno Acumulado	516,20%	587,33%
Retorno % do Benchmark	87,89%	-
Melhor Retorno Mensal	4,76%	1,16%
Pior Retorno Mensal	-4,00%	0,79%
Número de Meses com Retorno Positivo	203	-
Número de Meses com Retorno Negativo	37	-
Risco		
Volatilidade 12 meses	4,61%	-
Volatilidade desde o início	3,18%	-
Indicadores de Patrimônio		
Patrimônio Líquido	R\$ 6.524.585,31	
Patrimônio Líquido Médio 12 meses	R\$ 6.703.017,48	
Patrimônio da estratégia ²	26.254.646,55	

Rentabilidade Acumulada
