

Opportunity Midi

Fundo de Investimento em Cotas de Fundo de Investimento Multimercado

PERFORMANCE

desde o início, em 26/11/02

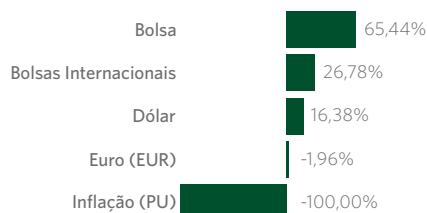


RENTABILIDADE MENSAL

	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maio	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro	Ano	% CDI	Ibovespa Annual
2002	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,19%	18,41%	18,63%	989,11%	10,19%
2003	-14,92%	-30,02%	27,84%	29,49%	23,18%	-13,02%	4,23%	42,17%	14,21%	36,47%	27,11%	24,75%	286,74%	1231,56%	97,33%
2004	6,68%	-3,73%	3,16%	-8,46%	5,25%	9,49%	10,23%	3,03%	-1,12%	-6,39%	10,99%	6,73%	39,18%	242,30%	17,81%
2005	-19,99%	39,16%	-11,94%	-17,17%	0,15%	-5,76%	2,67%	13,05%	18,67%	-5,68%	7,58%	4,67%	12,14%	63,90%	27,71%
2006	21,89%	3,52%	-1,95%	7,04%	-13,67%	-4,34%	3,15%	-2,69%	-0,63%	7,49%	8,40%	10,18%	40,04%	266,10%	32,93%
2007	-0,38%	-3,01%	2,43%	9,93%	30,33%	4,27%	8,93%	-13,26%	20,51%	11,03%	-9,03%	8,31%	84,19%	712,01%	43,65%
2008	-15,36%	18,92%	-22,60%	33,22%	55,73%	-12,54%	-7,85%	-18,29%	-31,43%	-14,93%	0,76%	3,67%	-35,13%	-	-41,22%
2009	1,94%	-13,83%	-0,77%	34,45%	36,80%	-12,56%	9,26%	-3,18%	24,29%	18,46%	6,76%	-3,31%	125,38%	1266,89%	82,66%
2010	10,32%	-15,21%	6,06%	-17,09%	-16,44%	-16,36%	12,66%	-8,29%	13,40%	3,94%	3,99%	-5,16%	-30,96%	-	1,04%
2011	5,76%	-6,56%	-13,15%	-1,68%	-8,71%	-1,18%	3,06%	-25,00%	-8,42%	10,30%	-14,02%	-9,76%	-53,88%	-	-18,11%
2012	28,21%	-5,82%	-10,62%	-1,82%	-25,00%	7,06%	-2,13%	-1,35%	5,29%	1,21%	-2,23%	4,24%	-10,77%	-	7,40%
2013	6,94%	1,21%	1,51%	4,90%	2,22%	-10,71%	4,43%	-8,20%	3,97%	12,17%	1,80%	1,50%	21,52%	240,26%	-15,50%
2014	-10,97%	3,93%	-1,21%	3,82%	0,78%	2,77%	6,70%	16,56%	-21,56%	-5,35%	7,16%	-3,99%	-6,62%	-	-16,92%
2015	-8,25%	6,02%	6,57%	-5,97%	-1,21%	-4,29%	8,67%	-7,04%	-1,15%	3,27%	5,80%	-5,46%	-4,93%	-	-14,42%
2016	-3,50%	-5,34%	7,79%	3,59%	-4,37%	13,25%	7,30%	1,91%	-1,17%	10,25%	-8,29%	0,91%	21,81%	155,76%	38,93%
2017	7,93%	4,87%	-3,46%	-0,47%	-8,58%	0,47%	6,30%	7,51%	0,96%	-1,65%	-2,17%	4,68%	16,09%	161,66%	26,86%
2018	9,30%	0,40%	-1,48%	1,49%	-6,82%	-2,89%							-0,72%	-	-4,76%

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

em 14/06/18



RISCO X RETORNO

	Desde o Início			12 Meses		
	Fundo	CDI	Ibovespa	Fundo	CDI	Ibovespa
Retorno Acumulado	1061,92%	195,88%	611,51%	15,37%	208,67%	15,68%
Volatilidade Anualizada	46,12%	-	22,63%	16,58%	-	20,82%
Índice de Sharpe ¹	0,10	-	0,03	0,48	-	0,40
Nº de Meses Positivos	106	-	106	7	-	7
Nº de Meses Negativos	82	-	82	5	-	5
Nº de Meses > Benchmark	100	-	-	6	-	-
Nº de Meses < Benchmark	88	-	-	6	-	-
Maior Rentabilidade Mensal	55,73%	6396,21%	16,97%	9,30%	1594,91%	11,14%
Menor Rentabilidade Mensal	-31,43%	-	-24,80%	-6,82%	-	-10,87%
			Retornos Anualizados Desde o Início	Fundo		17,10%
				CDI		12,72%
				Ibovespa		13,46%

Exposição ao Thesis Master FI Multimercado: 99,60%.

INFORMAÇÕES SOBRE O FUNDO³

Política de Investimento

Obter retornos no longo prazo, mediante a aplicação de, no mínimo 95%, de seus recursos em cotas do Opportunity Thesis Master FIM ("Fundo Master"), que aplica em uma carteira diversificada entre os mercados de renda fixa de títulos públicos e privados, juros, câmbio, ações, dívida externa e commodities, utilizando-se dos instrumentos disponíveis tanto no mercado à vista quanto no mercado de derivativos, no Brasil e no exterior. O Fundo Master possui perfil agressivo.

Resgates

Até 14h | Cotização em D+1, Pagamento em D+4.

Público-Alvo

Investidores qualificados.

Patrimônio Líquido (PL)

R\$ 24.316.986,84

PL do Opp. Midi Master FIM⁴

R\$ 125.285.590,49

Classificação ANBIMA

Multimercados Livre.

Classificação Tributária

Ações.

Investimento Mínimo⁵

R\$ 100.000,00

PL Médio/12 Meses

R\$ 26.764.713,95

PL Médio/12m do Opp. Midi Master FIM

R\$ 124.972.510,68

Código ANBIMA

110574

Código ISIN

BROPMDCTF006

Taxa de Administração Máxima

2,0% a.a. calculada e provisionada diariamente e paga mensalmente.

Taxa de Performance

20% sobre o que exceder a variação do CDI, provisionada por dia útil e paga semestralmente.

Taxas de Saída⁶

Não há.

Aplicações

Até 14h | Cotização em D+1.

¹O índice de Sharpe é calculado com base na média aritmética das variações mensais, tendo como ativo livre de risco a poupança. - ²O Stress utilizado pelo fundo é o valor de perda ex-ante, em pontos percentuais, que o portfólio pode ter em um intervalo de 3 dias dado um cenário de estresse. - ³Estes dados podem ser alterados a exclusivo critério do administrador. - ⁴O PL do Fundo Master compreende investimentos de fundos abertos, inclusive o aqui citado, e fundos restritos - ⁵O somatório das aplicações por CPF/CNPJ não poderá exceder R\$ 300.000,00 (trezentos mil reais) e o valor total de investimento na data da aplicação não poderá exceder 5% do saldo investido por CPF/CNPJ nos fundos geridos pelo Opportunity Asset Administradora de Recursos de Terceiros Ltda. Valor mínimo para movimentação: R\$ 5.000,00 | Saldo mínimo de permanência: R\$ 25.000,00. - ⁶Tal indicador é mera referência econômica e não representa o benchmark do Fundo.

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. desde 21/03/2011. - Gestor: Opportunity Asset Administradora de Recursos de Terceiros Ltda. e, desde 16/03/2011, Opportunity Gestão Internacional de Recursos Ltda. - Em 31 de dezembro de 2010, a gestora Opportunity Lógica Gestão de Recursos Ltda. foi incorporada à Opportunity Asset Administradora de Recursos de Terceiros Ltda. Em 09/04/2008, o FUNDO transformou-se em um fundo de investimento em cotas de fundo de investimento multimercado. - Em atendimento à Instrução CVM nº 465, desde 02/05/2008 os fundos de ações e multimercado deixaram de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações, passando a fazê-lo com base na cotação de fechamento. Assim, comparações de rentabilidade devem utilizar para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média dos índices de ações e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. - A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. - As rentabilidades informadas são brutas de impostos. - Fundos de investimento não contam como garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro, ou ainda do Fundo Garantidor de Créditos/FGC. - Ao investidor é obrigatória a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento do fundo de investimento antes de aplicar seus recursos. - Este fundo pode aplicar em fundos que utilizam estratégias com derivativos como parte de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. - Para fins de resgate, a data de sua solicitação, a data de conversão das cotas e a data de pagamento diferem entre si. - O Fundo está autorizado a realizar aplicações em fundos de investimentos que aplicam seus recursos em ativos financeiros no exterior. - Os fundos de investimento em ações e os fundos de investimento multimercados podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. - A taxa de administração compreende as taxas de administração dos fundos de investimento nos quais o fundo eventualmente venha a aplicar seus recursos. - Algumas das informações aqui apresentadas podem ter sido obtidas de fontes de mercado. Apesar de todo o cuidado em sua coleta e manuseio, o Opportunity não se responsabiliza pela publicação acidental de dados incorretos. - Fonte: Banco de Dados/Opportunity.