

# Opportunity Allocation

Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado.

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA em 28/02/2020



Compreendidos em 14 Fundos

Fundos Multimercado Macro  
**67,66%**

Fundos Long Short Direcional  
**8,88%**

Fundos Long Biased  
**22,87%**

Fundos Referenciados DI  
**0,63%**

## RISCO X RETORNO

	DESDE O ÍNICIO		12 MESES	
	FUNDO	%CDI	FUNDO	%CDI
Retorno Acumulado	521,92%	124,01%	9,20%	164,73%
Volatilidade Anualizada	4,67%	-	5,81%	-
Índice de Sharpe <sup>1</sup>	0,27	-	0,62	-
Nº de Meses Positivos	158	-	10	-
Nº de Meses Negativos	30	-	2	-
Nº de Meses > Benchmark	106	-	9	-
Nº de Meses < Benchmark	82	-	3	-
Maior Rentabilidade Mensal Nominal	4,80%	550,38%	3,15%	836,81%
Menor Rentabilidade Mensal Nominal	-5,23%	-	-2,49%	-
Maior Rentabilidade Mensal Relativa	3,15%	836,81%	3,15%	836,81%
Menor Rentabilidade Mensal Relativa	-2,49%	-	-2,49%	-
<b>Retornos Anualizados Desde o Início</b>			<b>Fundo</b>	<b>12,44%</b>
			<b>CDI</b>	<b>11,17%</b>

## RENTABILIDADE MENSAL

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	% CDI
<b>2004</b>	-	-	-	-	-	-	0,85%	1,40%	1,33%	0,83%	1,58%	1,94%	<b>8,19%</b>	<b>108,31%</b>
<b>2005</b>	0,32%	2,85%	0,38%	0,64%	0,72%	1,56%	1,35%	0,64%	2,68%	1,64%	2,03%	1,16%	<b>17,16%</b>	<b>90,30%</b>
<b>2006</b>	2,89%	1,37%	0,74%	1,99%	-1,01%	1,58%	1,77%	2,48%	1,10%	2,10%	1,62%	1,94%	<b>20,19%</b>	<b>134,16%</b>
<b>2007</b>	1,15%	0,68%	1,74%	2,19%	3,21%	1,47%	1,97%	-2,08%	2,37%	1,37%	-1,28%	1,33%	<b>14,93%</b>	<b>126,30%</b>
<b>2008</b>	-1,48%	2,93%	-3,25%	3,59%	4,80%	-0,05%	-0,54%	-2,03%	-5,23%	-4,71%	1,62%	1,50%	<b>-3,38%</b>	-
<b>2009</b>	1,80%	0,09%	1,80%	4,76%	4,48%	0,71%	2,69%	1,05%	2,98%	2,01%	1,44%	0,94%	<b>27,65%</b>	<b>279,36%</b>
<b>2010</b>	2,15%	-0,60%	1,10%	-1,16%	-0,82%	0,23%	1,53%	0,53%	0,78%	1,36%	0,71%	0,69%	<b>6,66%</b>	<b>68,34%</b>
<b>2011</b>	0,53%	0,29%	1,09%	0,58%	-0,04%	0,17%	0,21%	0,75%	1,21%	1,31%	0,45%	0,28%	<b>7,06%</b>	<b>60,86%</b>
<b>2012</b>	2,33%	1,54%	0,73%	1,35%	-0,35%	0,75%	1,49%	0,88%	1,23%	1,03%	0,89%	1,93%	<b>14,68%</b>	<b>174,45%</b>
<b>2013</b>	1,38%	0,61%	0,91%	0,62%	1,40%	-0,77%	1,19%	0,98%	-0,19%	1,01%	1,90%	0,87%	<b>10,34%</b>	<b>128,43%</b>
<b>2014</b>	-0,23%	0,20%	0,42%	0,13%	0,66%	0,57%	0,93%	1,64%	0,44%	-0,88%	1,92%	0,59%	<b>6,54%</b>	<b>60,56%</b>
<b>2015</b>	0,57%	2,05%	2,83%	-0,54%	1,71%	0,14%	3,48%	0,11%	1,02%	0,74%	1,65%	0,95%	<b>15,66%</b>	<b>118,36%</b>
<b>2016</b>	1,50%	0,59%	-0,90%	2,09%	0,86%	2,02%	1,99%	1,74%	1,04%	2,53%	-0,05%	2,14%	<b>16,66%</b>	<b>118,99%</b>
<b>2017</b>	2,24%	1,60%	0,87%	0,50%	-1,19%	0,98%	2,52%	1,49%	1,81%	-0,40%	-0,58%	1,61%	<b>12,00%</b>	<b>120,55%</b>
<b>2018</b>	3,73%	0,89%	0,72%	1,12%	-2,32%	0,08%	1,71%	0,00%	0,15%	2,79%	0,31%	-0,36%	<b>9,05%</b>	<b>140,83%</b>
<b>2019</b>	4,40%	-0,41%	-0,53%	0,78%	1,30%	2,05%	0,78%	0,64%	0,74%	1,56%	0,21%	3,15%	<b>15,57%</b>	<b>260,89%</b>
<b>2020</b>	0,75%	-2,49%											<b>-1,76%</b>	-

## PERFORMANCE em 28/02/2020

	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES	48 MESES	DESDE O INÍCIO
Opportunity Allocation	3,91%	9,20%	18,30%	33,49%	58,43%	521,92%
CDI	2,40%	5,58%	12,35%	22,43%	39,43%	420,86%

## Informações sobre o fundo<sup>2</sup>.

### POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O Fundo busca investir em cotas de emissão de fundos de investimento e de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento de quaisquer classes, os quais, por sua vez, invistam nos mercados de renda fixa de títulos públicos e privados, juros, câmbio, ações, dívida externa e commodities, utilizando-se dos instrumentos disponíveis nos mercados à vista e de derivativos, no Brasil e no exterior.

### PÚBLICO-ALVO

Investidores Qualificados

### INVESTIMENTO MÍNIMO

R\$50.000,00

### TAXA DE PERFORMANCE

Não há

### PATRIMÔNIO LÍQUIDO (PL)

R\$ 65.651.163

### CÓDIGO ANBIMA

130818

### TAXA DE SAÍDA<sup>3</sup>

10% sobre valor resgatado.

### PL MÉDIO/12 MESES

R\$ 79.236.056

### CÓDIGO ISIN

BROPTACTF007

### APLICAÇÕES

Até 12h | cotização em D+0

### CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Multimercados dinâmico

### TAXA DE ADM. MÍNIMA

0,5% a.a. calculada e provisionada diariamente e paga mensalmente.

### RESGATES

Até 12h | cotização em D+31 | pagamento em D+32. Caso o Fundo aplique em cotas de outros fundos com prazos de cotização superior, os mesmos serão observados.

### CLASSIFICAÇÃO TRIBUTÁRIA

Longo Prazo

<sup>1</sup>O índice de Sharpe é calculado com base na média aritmética das variações mensais, tendo como ativo livre de risco a poupança. - <sup>2</sup>Estes dados podem ser alterados a exclusivo critério do administrador. - <sup>3</sup>A taxa de saída será cobrada quando, mediante solicitação do cotista, a conversão das cotas ocorrer no 4º dia útil após o pedido de resgate.

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. - Gestor: Opportunity Asset Administradora de Recursos de Terceiros 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 29/12/2008 o Opportunity Allocation FIC FIM passou a ser administrado pela BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A sem qualquer modificação em suas demais características. - 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 utilizem 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 investimento que aplicam seus recursos em ativos financeiros no exterior. - Não há garantia de que o Fundo terá tratamento tributário para fundos de longo prazo. - Fundos de investimento em ações e fundos de investimento multimercados podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. - 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. - O Fundo está sujeito ainda às taxas de administração, performance e de qualquer outra natureza cobradas pelos Fundos investidos.