

# Opportunity Set Equities

Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado.

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA em 28/02/2020



Compreendidos em 11 Fundos

## RISCO X RETORNO

	DESDE O ÍNICIO		12 MESES	
	FUNDO	IBOVESPA	FUNDO	IBOVESPA
Retorno Acumulado	140,14%	90,67%	23,28%	8,98%
Volatilidade Anualizada	13,76%	22,48%	16,72%	19,31%
Índice de Sharpe <sup>1</sup>	0,30	-	1,06	-
Nº de Meses Positivos	53	49	10	8
Nº de Meses Negativos	29	33	2	4
Nº de Meses > Benchmark	44	-	10	-
Nº de Meses < Benchmark	38	-	2	-
Maior Rentabilidade Mensal Nominal	12,64%	10,19%	8,74%	6,85%
Menor Rentabilidade Mensal Nominal	-8,53%	-11,70%	-6,96%	-8,43%
Maior Rentabilidade Mensal Relativa	-1,25%	-10,09%	1,88%	3,51%
Menor Rentabilidade Mensal Relativa	5,78%	16,97%	2,07%	-
<b>Retornos Anualizados Desde o Início</b>			<b>Fundo</b>	<b>13,89%</b>
			<b>Ibovespa</b>	<b>10,06%</b>

## RENTABILIDADE MENSAL

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	IBOV.	EXC. DE RETORNO	ACUMUL.	ACUMUL. IBOV.	EXC. DE RETORNO
2013	-	-	-	-	-0,25%	-5,07%	1,44%	1,38%	2,62%	3,36%	-0,06%	-1,28%	1,92%	-5,72%	7,65%	1,92%	-5,72%	7,65%
2014	-6,35%	0,87%	2,85%	1,81%	0,69%	2,66%	1,29%	6,95%	-8,53%	1,04%	2,53%	-4,36%	0,38%	-2,91%	3,29%	2,31%	-8,47%	10,78%
2015	-4,95%	5,38%	1,80%	3,62%	-1,97%	0,41%	0,05%	-4,30%	-0,71%	1,62%	0,43%	-1,10%	-0,20%	-13,31%	13,11%	2,11%	-20,65%	22,76%
2016	-0,98%	2,49%	5,78%	3,94%	-1,25%	4,67%	7,56%	0,12%	-0,57%	6,70%	-5,83%	-0,43%	23,53%	38,93%	-15,40%	26,13%	10,24%	15,90%
2017	5,30%	2,83%	-0,37%	1,55%	-2,87%	1,29%	4,02%	5,77%	4,06%	-0,31%	-2,85%	4,63%	25,04%	26,86%	-1,82%	57,72%	39,84%	17,87%
2018	6,21%	0,16%	-0,40%	-0,81%	-7,52%	-3,84%	6,04%	-2,76%	1,20%	12,64%	3,46%	0,67%	14,42%	15,03%	-0,61%	80,46%	60,86%	19,60%
2019	9,59%	-1,51%	-0,08%	1,34%	1,78%	4,38%	3,68%	0,85%	2,07%	2,08%	2,06%	8,74%	40,39%	31,58%	8,81%	153,36%	111,67%	41,69%
2020	1,88%	-6,96%											-5,21%	-9,92%	4,71%	140,14%	90,67%	49,47%

## PERFORMANCE em 28/02/2020

	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES	48 MESES	DESDE O INÍCIO
Opportunity Set Equities	9,61%	23,28%	43,13%	75,83%	131,76%	140,14%
Ibovespa	3,00%	8,98%	22,05%	56,27%	143,43%	90,67%

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

## POLÍTICA DE INVESTIMENTO

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.

A carteira do Fundo deverá estar enquadrada para fins fiscais como de Ações, de acordo com a legislação em vigor, ou seja, buscará manter 95% de seu patrimônio líquido em fundos de investimento cujo principal fator de risco são ações.

## PÚBLICO-ALVO

Investidores Qualificados

## INVESTIMENTO MÍNIMO

R\$50.000,00

## TAXA DE ADM. MÍNIMA

0,04% sobre o PL investido em fundos Opportunity;  
0,50% sobre o PL investido em qualquer outro ativo.

## PATRIMÔNIO LÍQUIDO (PL)

R\$ 29.884.022,44

## CÓDIGO ANBIMA

338001

## APLICAÇÕES

Até 12h. Cotização em D+1.

## PL MÉDIO/12 MESES

R\$ 26.782.528,26

## CÓDIGO ISIN

BRSET4CTF009

## RESGATES

Até 12h. Cotização em D+30. Pagamento em D+32.  
Caso o Fundo aplique em cotas de outros fundos com prazos de cotização superior, os mesmos serão observados.

## CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Multimercados Dinâmico

## TAXA DE PERFORMANCE

Não há

## CLASSIFICAÇÃO TRIBUTÁRIA

Renda variável

## TAXA DE SAÍDA

Não há

<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.

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. - Gestor: Opportunity Asset Administradora de Recursos de Terceiros Ltda. - Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. - A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. - Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro, ou Fundo Garantidor de Crédito/FGC. - Leia o prospecto e o regulamento antes de investir. - 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. - 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. Este Fundo tem menos de 12 (doze) meses. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. - Fonte: Banco de Dados/Opportunity. - O Fundo está sujeito ainda às taxas de administração, performance e de qualquer outra natureza cobradas pelos Fundos Investidos.