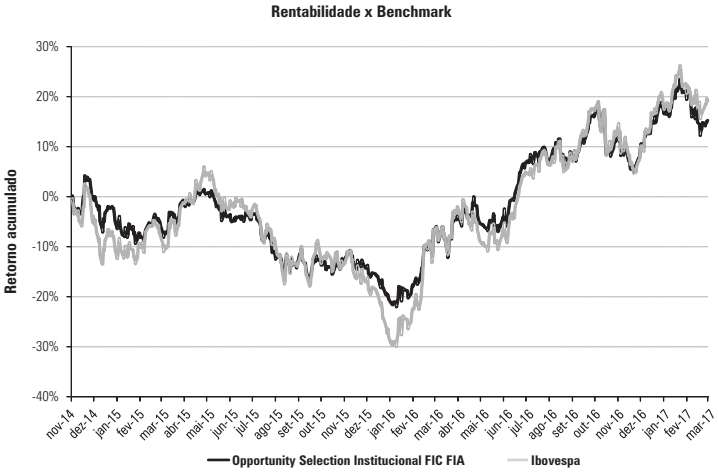
# Opportunity Selection Institucional

Fundo de Investimento em Cotas Fundo de Investimento em Ações

Mar/2017

## performance

desde o início, em 06/04/11




## risco X retorno

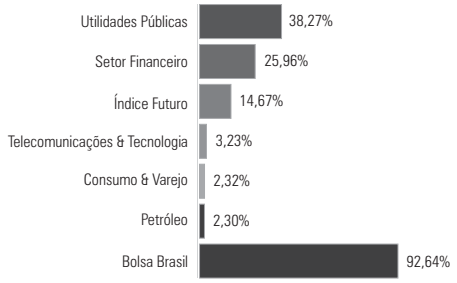
| | Desde o Início | | 12 Meses | |
|---|---|---|---|---|
| | Fundo | Ibovespa | Fundo | Ibovespa |
| Retorno Acumulado | 15,27% | 18,96% | 25,63% | 29,82% |
| Volatilidade Anualizada | 17,91% | 22,91% | 19,83% | 22,36% |
| Índice de Sharpe | -0,03 | 0,03 | 0,25 | 0,27 |
| Nº de Meses Positivos | 14 | 15 | 7 | 8 |
| Nº de Meses Negativos | 15 | 14 | 5 | 4 |
| Nº de Meses > *Benchmark* | 12 | - | 3 | - |
| Nº de Meses < *Benchmark* | 17 | - | 9 | - |
| Maior Rentabilidade Mensal | 11,04% | 15,41% | 11,04% | 11,31% |
| Menor Rentabilidade Mensal | -7,21% | -9,41% | -5,55% | -9,41% |
| **Retornos Anualizados Desde o Início** | | | **Fundo** | **5,97%** |
| | | | **Ibovespa** | **7,34%** |

## rentabilidade mensal

| | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maio | Junho | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro | Ano | IBRX 100 | Excesso de Retorno | Acumulado | Acumulado IBRX 100 | Excesso de Retorno |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **2014** | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 3,42% | -5,54% | -2,30% | -7,98% | 5,68% | -2,30% | -7,98% | 5,68% |
| **2015** | -7,20% | 5,89% | -0,24% | 5,30% | -5,57% | 0,60% | -2,92% | -7,21% | -1,94% | -0,02% | 1,63% | -2,20% | -13,91% | -12,41% | -1,50% | -15,89% | -19,40% | 3,50% |
| **2016** | -2,40% | 2,95% | 8,57% | 5,91% | -4,11% | 5,71% | 10,12% | 0,18% | -1,41% | 11,04% | -5,55% | -1,58% | 31,48% | 36,70% | -5,21% | 10,59% | 10,18% | 0,41% |
| **2017** | 6,22% | 2,83% | -4,57% | | | | | | | | | | 4,24% | 8,14% | -3,90% | 15,27% | 19,15% | -3,88% |

## composição da carteira

em 31/03/2017




## posições

| Maiores Posições | |
|---|---|
| Maior | 15,7% |
| 5 maiores | 44,2% |
| 10 maiores | 61,5% |

| Volume Médio Diário | *Long* | *Short* | Bruto |
|---|---|---|---|
| >= R$ 30 mi | 68,5% | 0,0% | 68,5% |
| >= R$ 15 mi < 30 mi | 11,2% | 0,0% | 11,2% |
| >= R$ 2 mi < 15 mi | 2,0% | 0,0% | 2,0% |
| < R$ 2 mi | 1,8% | 0,0% | 1,8% |

| Market Cap | *Long* | *Short* | Bruto |
|---|---|---|---|
| >= R$ 10 bi | 59,7% | 0,0% | 59,7% |
| >= R$ 2 bi < R$ 10 bi | 23,9% | 0,0% | 23,9% |
| < R$ 2 bi | 0,0% | 0,0% | 0,0% |

## informações sobre o fundo[1]

**política de investimento:** O Fundo busca superar o retorno do Ibovespa, sem necessariamente acompanha-lo, mediante a aplicação de, no mínimo 95%, de seus recursos em cotas do Opportunity Selection Master Fundo de Investimento em Ações ("Fundo Master"). O Fundo Master possui gestão ativa no mercado brasileiro de renda variável. Sua política de investimento consiste em aplicar no mercado brasileiro de ações. O Fundo Master tem poder discricionário para aplicar em ações de primeira, segunda e terceira linhas e, inclusive, nas de baixa liquidez e, ainda, em operações com derivativos tanto para hedge como para alavancagem, envolvendo contratos referenciados em ações e índices de ações.

**aplicações:** até 14h | cotização em D+1
**resgates:** até 14h | cotização em D+1 | pagamento em D+4

**público-alvo:** investidores em geral

**taxa de administração máxima:** 2,0% a.a. calculada e provisionada diariamente e paga mensalmente.
**taxa de performance:** 20% da rentabilidade da cota que exceder 100% do Ibovespa Fechamento. A taxa é provisionada por dia útil e paga semestralmente.
**taxas de ingresso e saída:** não há

**investimento mínimo:** R$ 50.000,00

**patrimônio líquido (PL):** R$ 11.527.264,02
**PL médio/12 meses:** R$ 10.904.673,06
**PL do Opp. Selection Institucional Master FIM[2]:** R$ 11.521.762,42
**PL médio/12m do Opp. Selection Institucional Master FIM:** R$ 10.911.970,95

**classificação tributária:** ações
**classificação ANBIMA:** Ações Livre

**código ISIN:** BRSEL1CTF003
**código ANBIMA:** 271063

[1] Estes dados podem ser alterados a exclusivo critério do administrador. - [2] O PL do Fundo Master compreende investimentos de fundos abertos, inclusive o aqui citado, e fundos restritos.

ANBIMA A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. - Gestor: Opportunity Asset Administração de Recursos de Terceiros Ltda. - 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. - O objetivo do Opportunity Selection FIC FIA consiste apenas em um referencial, não havendo garantia que o mesmo será atingido. Este fundo pode utilizar ou 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. - 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. - 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.