

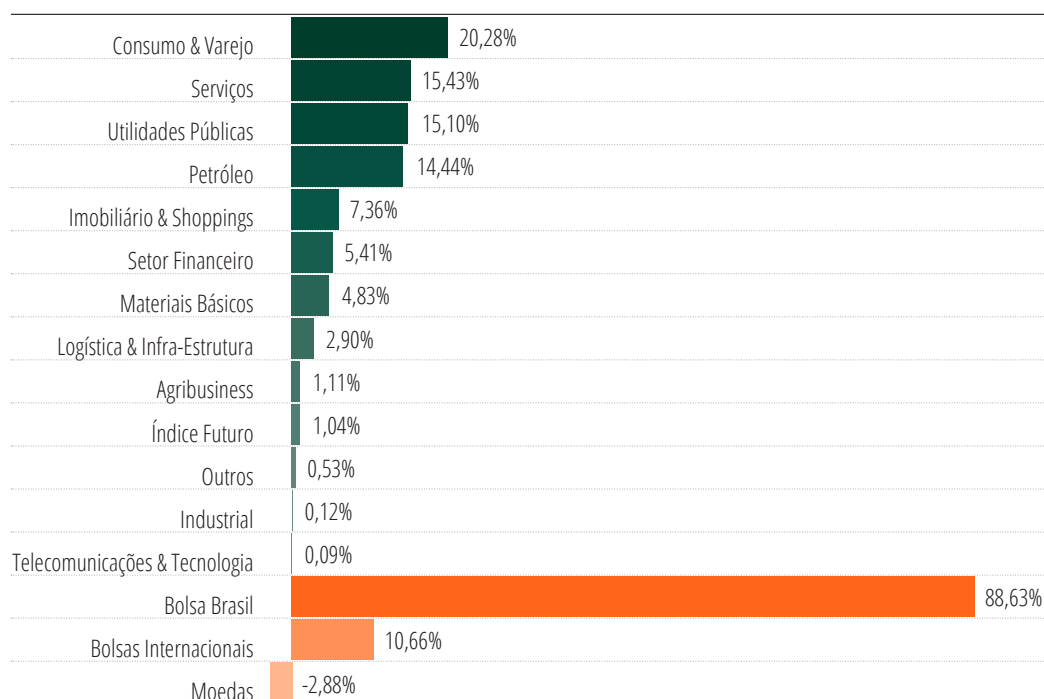
Opportunity Lógica II

Fundo de Investimento em Cotas Fundos de Investimento em Ações.

PERFORMANCE desde o início, em 31/05/1996



COMPOSIÇÃO DE CARTEIRA em 28/02/2020



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
1996	-	-	-	-	-	3,59%	-2,08%	-3,91%	-0,42%	8,91%	2,76%	14,39%	24,26%	22,86%	1,40%	24,26%	22,86%	1,40%
1997	17,20%	12,18%	0,77%	8,68%	25,04%	17,94%	-1,58%	-20,63%	5,49%	-24,11%	7,95%	5,52%	51,22%	44,43%	6,79%	87,90%	77,45%	10,46%
1998	-8,38%	8,44%	9,91%	-1,06%	-11,71%	-14,69%	12,48%	-15,89%	2,12%	-11,14%	20,71%	-20,61%	-33,06%	-33,35%	0,29%	25,78%	18,27%	7,51%
1999	35,01%	10,44%	50,16%	5,28%	-0,14%	5,60%	-8,98%	-3,23%	14,68%	6,58%	16,75%	26,64%	295,66%	150,95%	144,71%	397,66%	196,80%	200,86%
2000	-2,13%	14,77%	2,18%	-12,19%	-3,86%	19,98%	-1,59%	13,46%	-7,46%	-5,90%	-6,57%	-0,96%	4,60%	-10,47%	15,06%	420,54%	165,74%	254,80%
2001	18,35%	-2,05%	-9,90%	7,21%	0,74%	-4,34%	-1,46%	1,76%	-8,07%	1,94%	6,50%	5,93%	14,40%	-9,79%	24,19%	495,48%	139,73%	355,75%
2002	-6,28%	11,18%	-1,24%	-2,33%	-5,87%	-7,18%	-12,67%	9,54%	-18,55%	19,94%	-2,16%	6,02%	-14,88%	-17,80%	2,92%	406,87%	97,06%	309,81%
2003	-6,46%	-7,30%	8,08%	14,96%	5,52%	0,14%	4,26%	14,62%	5,90%	12,92%	16,21%	19,07%	125,10%	97,10%	28,00%	1.040,98%	288,42%	752,56%
2004	1,29%	2,31%	5,34%	-15,39%	-6,37%	8,77%	12,47%	8,72%	5,57%	-0,14%	8,93%	5,70%	39,61%	17,75%	21,86%	1.492,93%	357,35%	1.135,58%
2005	-7,05%	14,99%	-8,90%	-6,37%	2,48%	-1,16%	3,99%	10,47%	9,08%	-6,53%	5,27%	4,30%	18,75%	27,06%	-8,31%	1.791,54%	481,09%	1.310,45%
2006	16,83%	1,01%	-2,74%	7,20%	-7,35%	-0,36%	2,23%	-0,54%	-1,13%	3,52%	6,89%	7,69%	36,06%	33,73%	2,33%	2.473,58%	677,09%	1.796,49%
2007	2,59%	-0,48%	3,24%	8,18%	10,21%	3,96%	-1,13%	-2,74%	6,69%	6,12%	-4,59%	4,49%	41,79%	43,68%	-1,89%	3.549,18%	1016,54%	2.532,63%
2008	-9,80%	6,78%	-12,84%	11,70%	16,69%	-8,76%	-4,72%	-7,75%	-12,09%	-19,64%	2,80%	3,34%	-34,14%	-41,25%	7,10%	2.303,19%	556,02%	1.747,18%
2009	1,40%	-4,74%	6,62%	19,21%	13,43%	-6,65%	9,97%	-2,00%	15,24%	8,50%	5,40%	-0,13%	84,42%	82,66%	1,76%	4.331,93%	1098,26%	3.233,67%
2010	1,86%	-1,32%	5,37%	-9,71%	-7,38%	-9,97%	10,56%	-5,73%	9,28%	2,79%	-1,22%	-1,21%	-8,91%	1,04%	-9,95%	3.937,16%	1110,78%	2.826,38%
2011	4,77%	-2,33%	-5,62%	-0,42%	-4,23%	-1,01%	1,29%	-9,49%	-4,70%	6,70%	-5,78%	-4,39%	-23,42%	-18,11%	-5,31%	2.991,61%	891,51%	2.100,10%
2012	14,98%	-1,01%	-4,99%	-1,41%	-17,19%	7,76%	-5,44%	-5,70%	0,73%	3,00%	-1,75%	5,72%	-8,60%	7,40%	-15,99%	2.725,88%	964,85%	1.761,03%
2013	0,86%	-2,82%	1,54%	4,33%	-0,87%	-9,06%	3,60%	-4,76%	1,97%	7,03%	1,20%	-0,73%	1,26%	-15,50%	16,76%	2.761,61%	799,85%	1.961,77%
2014	-6,30%	1,07%	-2,43%	2,71%	-0,02%	2,48%	5,39%	10,75%	-19,13%	-5,55%	2,98%	-4,45%	-14,69%	-2,91%	-11,78%	2.341,15%	773,64%	1.567,51%
2015	-6,59%	6,96%	4,75%	-2,54%	-0,16%	-3,93%	6,30%	-6,44%	-0,38%	2,58%	3,65%	-5,24%	-2,35%	-13,31%	10,97%	2.283,84%	657,34%	1.626,51%
2016	-4,57%	-3,73%	-2,32%	3,89%	-4,20%	13,01%	6,71%	1,13%	-1,43%	10,95%	-8,76%	0,87%	9,63%	38,93%	-29,30%	2.513,45%	952,19%	1.561,26%
2017	6,97%	4,77%	-4,18%	-0,67%	-8,82%	0,29%	5,76%	7,53%	2,94%	-2,43%	-2,54%	4,80%	13,81%	26,86%	-13,04%	2.874,49%	1.234,77%	1.639,72%
2018	10,00%	0,22%	-1,42%	1,44%	-8,05%	-3,01%	7,56%	-0,78%	1,70%	8,09%	3,22%	-0,06%	18,96%	15,03%	3,93%	3.438,45%	1.435,42%	2.003,03%
2019	11,13%	-1,62%	-0,24%	0,82%	1,02%	4,55%	2,85%	1,87%	1,55%	3,27%	1,22%	10,92%	43,29%	16,80%	26,48%	4.970,20%	1.693,44%	3.276,76%
2020	2,76%	-7,56%											-5,01%	-9,92%	4,91%	4716,22%	1515,51%	3200,72%

RISCO X RETORNO

	DESDE O INÍCIO		12 MESES	
	FUNDO	IBOVESPA	FUNDO	IBOVESPA
Retorno Acumulado	4716,22%	1719,91%	24,49%	8,98%
Volatilidade Anualizada	29,42%	31,31%	20,12%	19,31%
Índice de Sharpe ¹	71,60	(27,42)	1,32	0,26
Nº de Meses Positivos	158	166	10	8
Nº de Meses Negativos	127	119	2	4
Nº de Meses > Benchmark	158	-	9	-
Nº de Meses < Benchmark	127	-	3	-
Maior Rentabilidade Mensal	50,16%	26,35%	10,92%	6,85%
Menor Rentabilidade Mensal	-24,11%	-39,27%	-7,56%	-8,43%
Retornos Anualizados Desde o Início			Fundo	17,45%
			Ibovespa	12,80%

RISCO X RETORNO

	MAIOR	5 MAIORES	10 MAIORES
Maiores Posições	9,6%	30,7%	48,7%
VOLUME MÉDIO DIÁRIO	LONG	SHORT	BRUTA
>= R\$ 30 MI	81,9%	-5,1%	87,0%
>= R\$ 15 MI < 30 MI	1,3%	0,0%	1,3%
>= R\$ 2 MI < 15 MI	0,6%	0,0%	0,6%
< R\$ 2 MI	1,5%	0,0%	1,5%
MARKET CAP	LONG	SHORT	BRUTA
>= R\$ 10 Bi	73,5%	-5,1%	78,6%
>= R\$ 2 Bi < R\$ 10 Bi	10,3%	0,0%	10,3%
< R\$ 2 Bi	1,5%	0,0%	1,5%

Informações sobre o fundo².

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O Fundo busca superar o retorno do Ibovespa, sem necessariamente acompanhá-lo, mediante a aplicação de, no mínimo 95%, de seus recursos em cotas do Opportunity Lógica Master Fundo de Investimento em Ações ("Fundo Master"). O Fundo Master possui gestão ativa no mercado de renda variável, atuando eventualmente nos mercados de renda fixa como juros e câmbio. Sua política de investimento consiste em investir em uma carteira diversificada de ativos financeiros com foco em Brasil, mas podendo investir no exterior. O Administrador 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, índices de ações, taxas de juros ou câmbio.

PÚBLICO-ALVO

Investidores em Geral.

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Ações Livre

CLASSIFICAÇÃO TRIBUTÁRIA

Ações

CÓDIGO ANBIMA

026311

CÓDIGO ISIN

BRLGIICTF008

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO MÁXIMA

3,0% calculada e provisionada diariamente e paga mensalmente.

APLICAÇÕES

Até 14h | Cotização em D+1.

RESGATES

Até 14h | cotização em D+1.
Pagamento em D+3.

INVESTIMENTO MÍNIMO

R\$ 100.000,00

PATRIMÔNIO LÍQUIDO (PL)

R\$ 389.862.347,71

PL MÉDIO/12 MESES

R\$ 364.751.765,99

TAXA DE PERFORMANCE

Não há.

TAXAS DE INGRESSO E SAÍDA

Não há.

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. - *Estes dados podem ser alterados a exclusivo critério do administrador.

Em 05/08/1996 o fundo alterou sua denominação para Opportunity Lógica II FMA-CL. Finalmente, em 31/05/2000, dentro do processo de adaptação às regras da Instrução CVM 302, o fundo incorporou o Opportunity Lógica FMA-CL, e passou a ter a denominação: Opportunity Lógica II FIA. Os fundos Opportunity Silver FIA e Opportunity I FIA foram incorporados pelo Opportunity Lógica II FIA em 11/10/2006 e 26/10/2006, respectivamente. Em 03/03/2011, ocorreu a cisão do fundo Opportunity Lógica II FIA que foi transformado em fundo de investimento em cotas de fundos de investimento em ações e passou a ter sua atual denominação: Opportunity Lógica II FIC FIA. Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. desde 05/12/2011. - Gestores: Opportunity Gestora de Recursos Ltda./Opportunity Asset Administradora de Recursos de Terceiros Ltda. e, desde 31/03/2011, 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 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 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. - O fundo está autorizado a realizar aplicações 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. - A taxa de administração compreende as taxas de administração dos fundos de investimento nos quais o fundo eventualmente venha a aplicar seus recursos. - Fonte: Banco de Dados/Opportunity