

Opp Allocation

[BRL]

Fundo de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento Multimercado.

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA em data 30/4/2021



Compreendidos em 18 Fundos

Multimercado Macro

68.37%

Long Biased

20.69%

Long Short Direcional

4.25%

DI

3.10%

Long Only

2.09%

Long & Short Neutro

1.49%

RENTABILIDADE MENSAL

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	%CDI	DESDE O INÍCIO	%CDI
2004	-	-	-	-	-	-	0.85%	1.40%	1.33%	0.83%	1.58%	1.94%	8.19%	108.31%	8.19%	108.31%
2005	0.32%	2.85%	0.38%	0.64%	0.72%	1.56%	1.35%	0.64%	2.68%	1.64%	2.03%	1.16%	17.16%	90.30%	26.75%	95.55%
2006	2.89%	1.37%	0.74%	1.99%	-1.01%	1.58%	1.77%	2.48%	1.10%	2.10%	1.62%	1.95%	20.19%	134.16%	52.33%	110.75%
2007	1.15%	0.68%	1.74%	2.19%	3.21%	1.47%	1.97%	-2.08%	2.37%	1.37%	-1.28%	1.33%	14.93%	126.30%	75.08%	116.11%
2008	-1.48%	2.93%	-3.25%	3.59%	4.80%	-0.05%	-0.54%	-2.03%	-5.23%	-4.71%	1.62%	1.50%	-3.38%	-	69.16%	81.34%
2009	1.80%	0.09%	1.80%	4.76%	4.48%	0.71%	2.69%	1.06%	2.98%	2.01%	1.44%	0.94%	27.65%	279.36%	115.94%	112.18%
2010	2.15%	-0.60%	1.10%	-1.16%	-0.82%	0.23%	1.53%	0.53%	0.78%	1.36%	0.71%	0.69%	6.66%	68.34%	130.31%	105.81%
2011	0.53%	0.29%	1.09%	0.58%	-0.04%	0.17%	0.21%	0.75%	1.21%	1.31%	0.45%	0.28%	7.06%	60.86%	146.56%	98.35%
2012	2.33%	1.55%	0.73%	1.35%	-0.35%	0.75%	1.50%	0.88%	1.23%	1.03%	0.89%	1.93%	14.68%	174.45%	182.75%	107.51%
2013	1.38%	0.61%	0.91%	0.62%	1.40%	-0.77%	1.19%	0.98%	-0.19%	1.01%	1.90%	0.87%	10.34%	128.43%	212.00%	110.58%
2014	-0.23%	0.20%	0.42%	0.13%	0.66%	0.57%	0.93%	1.64%	0.44%	-0.88%	1.92%	0.59%	6.54%	60.56%	232.42%	104.11%
2015	0.57%	2.05%	2.83%	-0.54%	1.71%	0.14%	3.48%	0.11%	1.02%	0.74%	1.65%	0.95%	15.66%	118.35%	284.46%	106.94%
2016	1.50%	0.59%	-0.90%	2.09%	0.86%	2.02%	1.99%	1.74%	1.04%	2.53%	-0.05%	2.14%	16.66%	118.99%	348.52%	109.85%
2017	2.24%	1.60%	0.87%	0.50%	-1.19%	0.98%	2.52%	1.49%	1.81%	-0.40%	-0.58%	1.61%	12.00%	120.55%	402.32%	112.14%
2018	3.73%	0.89%	0.72%	1.12%	-2.32%	0.08%	1.71%	0.00%	0.15%	2.79%	0.31%	-0.36%	9.05%	140.83%	447.76%	115.33%
2019	4.40%	-0.41%	-0.53%	0.78%	1.30%	2.05%	0.78%	0.64%	0.74%	1.56%	0.21%	3.15%	15.57%	260.89%	533.05%	127.71%
2020	0.75%	-2.49%	-11.83%	6.09%	2.87%	2.99%	4.11%	0.75%	-1.70%	0.10%	4.84%	3.46%	8.99%	324.94%	589.98%	136.66%
2021	-0.63%	0.45%	0.90%	1.51%	-	-	-	-	-	-	-	-	2.24%	323.99%	605.44%	139.06%

RISCO X RETORNO

	DESDE O INÍCIO		12 MESES	
	FUNDO	CDI	FUNDO	CDI
Retorno Acumulado	605,44%	139,06%	21,26%	989,92%
Volatilidade Anualizada	6,09%	-	7,92%	-
Índice de Sharpe	0,30	-	2,41	-
Número de Meses Positivos	169	-	10	-
Número de Meses Negativos	33	-	2	-
Nº de Meses > Benchmark	116	-	9	-
Nº de Meses < Benchmark	86	-	3	-
Maior Rentabilidade Mensal Nominal	6,09%	2137,79%	4,84%	3235,00%
Menor Rentabilidade Mensal Nominal	-11,83%	-	-1,70%	-
Maior Rentabilidade Mensal Relativa	4,84%	3235,00%	4,84%	3235,00%
Menor Rentabilidade Mensal Relativa	-11,83%	-	-1,70%	-
Retornos Anualizados Desde o Início			FUNDO	12,38%
			CDI	10,54%

PERFORMANCE EM 30/4/2021

	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES	48 MESES	DESDE O INÍCIO
Opp Allocation	10.90%	21.26%	23.57%	31.75%	49.35%	605.44%
CDI	1.01%	2.15%	7.46%	14.28%	23.56%	435.38%

Informações sobre o fundo

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

Investidor Qualificado

INVESTIMENTO MÍNIMO

R\$ 50.000,00

TAXA DE PERFORMANCE

Não Há

PATRIMÔNIO LÍQUIDO (PL)

R\$ 60.245.625,07

APLICAÇÕES

Até 12h | Cotização em D+0.

CLASSIFICAÇÃO ANBIMA

Multimercado Dinâmicos.

PL MÉDIO/12 MESES

R\$ 59.756.302,50

RESGATES

Sem cobrança de taxa de saída: Até 12h | Cotização em D+30, Pagamento em D+31. Com cobrança de taxa de saída: Até 12h | Cotização em D+4, Pagamento em D+5.

CLASSIFICAÇÃO TRIBUTÁRIA

Longo Prazo.

PL DA ESTRATÉGIA

R\$ 81.000.611,91

TAXA DE SAÍDA

10% sobre o valor resgatado, em casos de resgate antecipado apenas.

CÓDIGO ANBIMA

130818

PL MÉDIO/12M DA ESTRATÉGIA

R\$ 68.238.577,92

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

0.04% sobre o PL investido em fundos Opportunity; 0.5% sobre o PL investido em qualquer outro ativo.

CÓDIGO ISIN

BROPTACTF007