

Material de Divulgação do Fundo

CNPJ
30.869.348/0001-80

Nome do fundo
OPPORTUNITY ICATU PREVIDÊNCIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

Gestor
OPPORTUNITY GESTÃO DE INVESTIMENTOS E RECURSOS LTDA

Administrador
BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.

Custodiante
BNY MELLON BANCO S.A.

Auditor independente
KPMG AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.

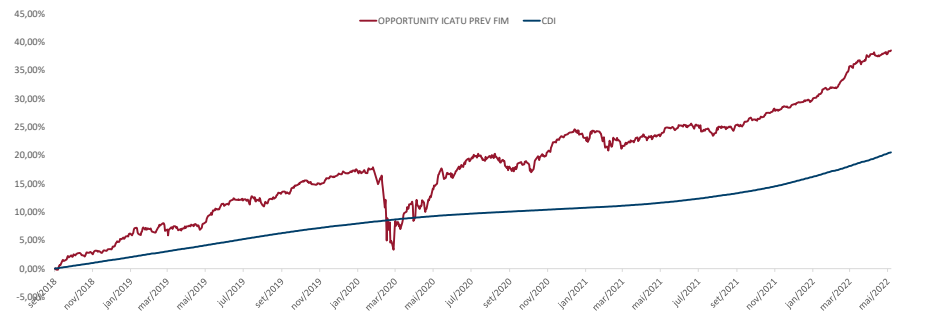
Informações do fundo
Classificação Anbima Previdência Multimercado Livre
Classificação CVM Fundo Multimercado
Código Anbima 487831
Código ISIN BR00CMCTF001
Lançamento 26/09/2018
Benchmark CDI
Cota Fechamento
Aplicações (Dias úteis) Depósito em D+0
Cota em D+0
Resgate (Dias úteis) Cota em D+1
Liquidação em D+3
Pagamento de acordo com o prazo dos planos*
Taxa de administração Mínima: 0,00%
Máxima: 1,50%
Efetiva: 1,40%
Taxa de performance Mínima: 0,00%
Máxima: Não há, mas poderá comprar cotas de fundos de investimento que possuem de taxa de performance Efetiva: Não há

Objetivo do fundo
O objetivo do FUNDO é atuar no sentido de propiciar ao cotista rentabilidade através da valorização de suas cotas, utilizando-se de um perfil não referenciado em indicador de desempenho em função da estrutura dos ativos financeiros e/ou modalidades operacionais integrantes da CARTEIRA, visando atingir rentabilidade superior às taxas diárias de remuneração de Certificados de Depósito Interfinanceiro - CDI.

Público Alvo

O fundo destina-se exclusivamente a receber, diretamente ou por meio dos seus Fundos de Investimento, recursos referentes às reservas técnicas de Plano Gerador de Benefício Livre - PGBL e de Vida Gerador de Benefício Livre - VGBL (conjuntamente os "Planos"), disciplinados pela Resolução do Conselho Monetário Nacional no 4.444 de 13.11.2015 (Res. CMN no 4.444/15), destinados a proponentes qualificados, instituídos pela Icatu Seguros S.A, doravante designado Cotista ou Instituidora, Investidor Profissional nos termos da Instrução CVM no 539, de 13.11.2013 (ICVM 539/13) e posteriores alterações.

Evolução da Rentabilidade Acumulada



Rentabilidades

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2018	Fundo									-0,17%	2,75%	0,58%	0,72%	3,91%	3,91%
	Benchmark %CDI									0,05%	0,54%	0,49%	0,49%	1,59%	1,59%
2019	Fundo	2,89%	-0,14%	0,19%	0,61%	1,62%	1,85%	0,53%	-0,14%	1,61%	1,54%	-0,27%	1,41%	12,28%	16,67%
	Benchmark %CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%	0,57%	0,50%	0,46%	0,48%	0,38%	0,37%	5,96%	7,64%
2020	Fundo	532,44%	-28,74%	39,52%	116,83%	297,95%	393,69%	93,57%	-27,90%	348,15%	321,80%	-71,05%	376,58%	206,07%	218,16%
	Benchmark %CDI	0,14%	-1,45%	-6,16%	3,02%	3,05%	1,85%	2,54%	-0,24%	-1,60%	-0,51%	3,07%	2,85%	6,31%	24,03%
2021	Fundo	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,21%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	2,76%	10,61%
	Benchmark %CDI	36,03%	-492,18%	-1620,86%	1059,99%	1293,38%	872,72%	1306,58%	-149,69%	-1019,90%	-321,75%	2052,59%	1734,78%	228,81%	226,50%
2022	Fundo	-1,34%	-0,33%	0,73%	0,86%	0,61%	0,93%	-0,79%	0,49%	0,24%	1,08%	1,17%	1,02%	4,20%	29,24%
	Benchmark %CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	4,42%	15,50%
2022	Fundo	-89,60%	-617,18%	360,88%	414,83%	226,72%	301,44%	-220,98%	113,57%	54,85%	222,17%	198,71%	132,48%	94,92%	188,61%
	Benchmark %CDI	0,73%	1,40%	2,60%	1,81%	0,48%	0,73%	0,83%	1,03%	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	4,36%
2022	Fundo	99,50%	185,07%	280,01%	216,41%	46,53%								165,09%	187,66%
	Benchmark %CDI														

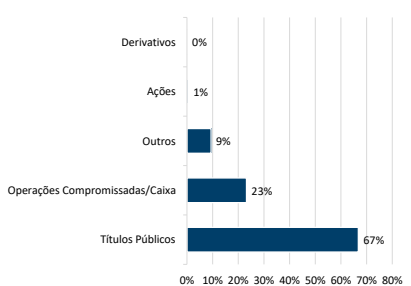
Indicadores Risco x Retorno

Indicador	12 meses	Desde o início
Nº Meses <0	1	11
Nº Meses >0	11	33
Nº Meses <Benchmark	4	17
Nº Meses >Benchmark	8	27
Maior Rentabilidade Mensal	2,60%	3,07%
Menor Rentabilidade Mensal	-0,79%	-6,16%
Maximum Drawdown	1,73%	12,36%
Volatilidade Anualizada	2,88%	6,65%
Índice de Sharpe	1,32	1,42

Rentabilidades Acumuladas

Período	Fundo	Benchmark	%CDI
Últimos 3 meses	4,95%	2,82%	175,45%
Últimos 6 meses	8,29%	5,16%	160,58%
Últimos 12 meses	11,69%	7,93%	147,40%
Últimos 24 meses	20,78%	10,28%	202,09%
Últimos 36 meses	26,69%	15,65%	170,53%
Últimos 48 meses			
Últimos 60 meses			
Desde o início	38,54%	20,54%	187,66%

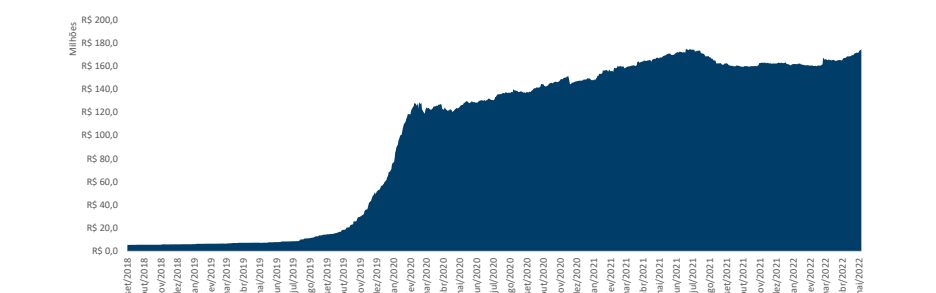
Composição da Carteira*



Data da carteira: mai/2022

*Número de aberturas consecutivas: 5

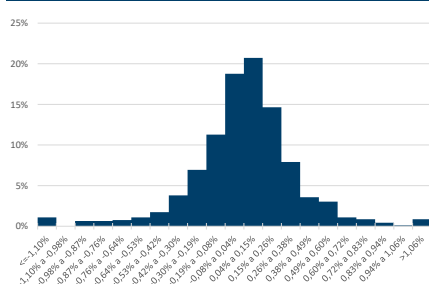
Evolução do Patrimônio Líquido



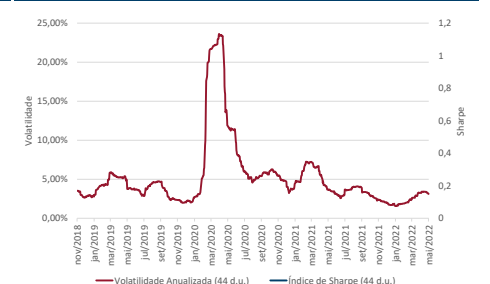
Patrimônio Líquido

	Atual	R\$
Médio nos últimos 12 meses		174.373.550,32
Médio desde o início		164.938.771,46
		100.920.478,00

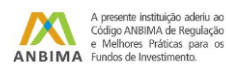
Histograma dos Retornos Diários



Evolução da Volatilidade / Índice de Sharpe*



*Índice calculado a partir da razão entre a média do retorno diário acima do cdi e a volatilidade diária.



* De acordo com as Circulares SUSEP nº 563/564 de 2017, para planos destinados à proponentes varejo e qualificados aprovados a partir de 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é de até 10 (dez) dias úteis e 180 (cento e oitenta) dias úteis, respectivamente, e para planos anteriores a 1º de janeiro de 2018, o prazo para crédito é até 5 (cinco) dias úteis. O crédito será efetuado pela Icatu Seguros até o prazo estipulado em norma, a contar do dia útil subsequente ao recebimento do formulário preenchido corretamente e mediante envio da documentação obrigatória solicitada. Os investimentos do Fundo estão sujeitos a flutuações de mercado e a riscos de crédito. É importante ressaltar que apesar do cuidado e diligência da Icatu Seguros no monitoramento de riscos do Fundo, sempre existe a possibilidade de oscilações superiores às estimativas utilizadas nos sistemas de controle, podendo ocasionar distanciamientos e perdas superiores às esperadas. Desta forma, investimentos no Fundo devem ser sempre considerados como aplicações de risco, tendo em vista a possibilidade de não ser alcançado o objetivo de investimento a que o Fundo se propõe, bem como a possibilidade de perda parcial ou total dos recursos investidos. Investimentos em Fundos que podem sofrer perdas patrimoniais não são garantidos pela Instituição Administradora, pelo Gestor de Carteira nem por qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. É recomendada a leitura cuidadosa do formulário de informações complementares e do regulamento do fundo pelo investidor ao aplicar seus recursos, podendo este ser encontrado em <http://www.cvm.gov.br/>. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. A descrição da classificação ANBIMA pode ser encontrada no formulário de informações complementares. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO: Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br)