

GAP Multiportfolio FIC FIM

Junho 2019

FECHADO PARA
NOVAS APLICAÇÕES (**)

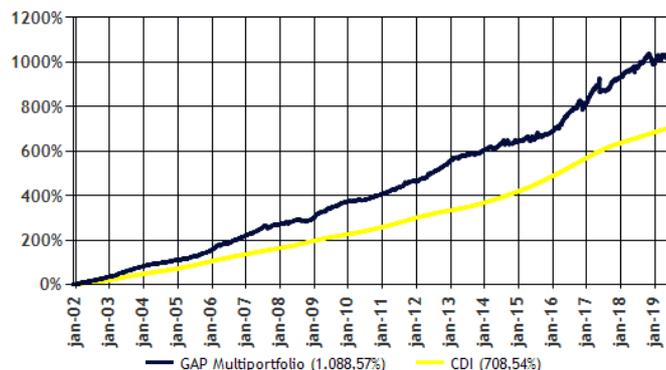
Objetivo: superar substancialmente a variação do CDI em qualquer período de 12 meses.

Política de Investimento: Consiste em alocar no mínimo 95% de suas cotas no GAP ABSOLUTO MASTER FIM, que procura capturar oportunidades nos mais diversos mercados (principalmente em câmbio, juros e bolsa), através da estruturação de operações com ativos e seus instrumentos derivativos relacionados a estes mercados, tendo como pano de fundo sólidas análises macro e microeconômicas.

Grau de Risco: agressivo.

Público-alvo: investidores que buscam, no longo prazo, superar o benchmark (CDI).

Rentabilidade Acumulada de 03/12/2001 a 28/06/2019



Rentabilidades

| Rentabilidades | Jun. 2019 | Mai. 2019 | Abr. 2019 | Mar. 2019 | Fev. 2019 | Jan. 2019 | Acum. 2019 | Acum. 12 meses | Acum. 24 meses | Acum. Início(*) |
|--------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|------------|----------------|----------------|-----------------|
| GAP Multiportfolio | 3,87% | 1,81% | -0,48% | 1,16% | -1,17% | 3,25% | 8,64% | 10,56% | 22,34% | 1.088,57% |
| CDI | 0,47% | 0,54% | 0,52% | 0,47% | 0,49% | 0,54% | 3,07% | 6,35% | 14,22% | 708,54% |
| Em % do CDI | 826,25% | 333,82% | - | 248,25% | - | 598,25% | 281,15% | 166,50% | 157,06% | 153,64% |

Média do PL nos últimos 12 meses: R\$ 199.016.151

Análises Estatísticas

| Análise Retornos | Retorno | Em % do CDI | Análise Retornos Mensais vs CDI | Nº meses | % s/total |
|------------------------|---------------|-------------|---------------------------------|----------|-----------|
| Maior retorno mensal | 4,15% | 222,30% | Meses abaixo de 50% do CDI | 44 | 20,85 |
| Menor retorno mensal | -3,12% | -631,50% | Meses entre 50% e 100% do CDI | 41 | 19,43 |
| Volatilidade Histórica | últ. 12 meses | | Meses entre 100% e 150% do CDI | 44 | 20,85 |
| Volatilidade | 4,65% | | Meses acima de 150% do CDI | 82 | 38,86 |
| VaR diário médio | 0,56% | | Total | 211 | 100,00% |

*VaR paramétrico com 95% de confiança e período de 1 dia.

Informações

Valor de aplicação inicial: R\$ 5.000,00

Valor mínimo de movimentação: R\$ 5.000,00

Saldo mínimo de permanência: R\$ 5.000,00

Horário para movimentações: Até 14 h, com recursos disponíveis na conta do fundo. Movimentações para novos clientes: até 13 h.

Conta-corrente para TED:

BNY MELLON BANCO S.A. (017) - Agência: 0001-0 - C/C: 1340-4

GAP Multiportfolio FIC FIM - CNPJ: 03.804.917/0001-37

Aplicação: Cota D+0.

Resgate: Cota D+0.

Liquidação Financeira - Resgate: D+1 (útil) da data de conversão de cotas.

Liquidez: Diária.

Taxa de administração: 1,95% ao ano.

Taxa de Performance: 20% sobre o ganho que exceder a variação do CDI - marca d'água.

Imposto de Renda: 15% sobre o ganho nominal para permanência superior a 2 anos.

IOF: Até 29 dias a contar da data da aplicação.

Gestora: GAP Gestora de Recursos LTDA.

Tels: 21 2142-1910

Fax: 21 2142-1932

www.gapasset.com.br

Administrador e Distribuidor:

BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.

Av. Presidente Wilson, 231, 11º andar, Rio de Janeiro, CEP 20030-905

Tel: 21 3219-2500 Fax 21 3219-2501 www.bnymellon.com.br/sf

SAC: sac@bnymellon.com.br, 21 3219-2600, 11 3050-8010

Ouvidoria: ouvidoria@bnymellon.com.br ou 0800 725 3219

Auditor: PriceWaterHouseCoopers Auditores Independentes.

Custodiante: BNY MELLON BANCO S.A.

Código Anbima: 99589.

Categoria Anbima: Multimercados Livre.

