

GAP Multiportfolio FIC FIM

Novembro de 2020

Objetivo

Superar a variação do CDI em horizontes de medio e longo prazo

Público alvo

Investidores em geral

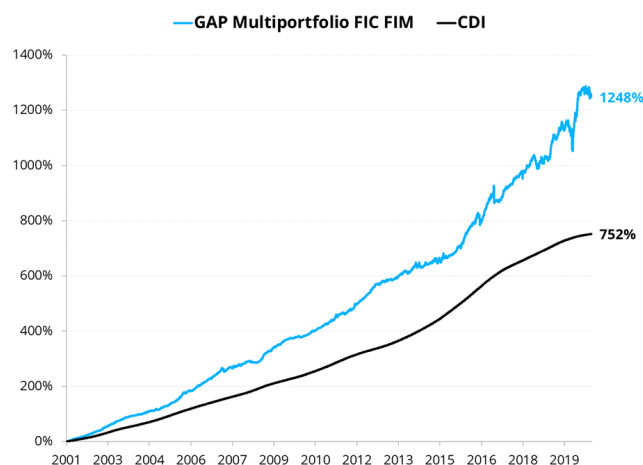
Grau de risco

Agressivo.

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), tanto no Brasil quanto no exterior, tendo como pano de fundo análises macroeconômicas sólidas e um controle de risco efetivo.

Gráfico comparativo



Rentabilidades

Fundo x Índice (%)	Mês	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	Início*
GAP Multiportfolio FIC FIM	-0,14	7,67	9,70	22,33	31,41	1.248,10
% CDI	-	295	325	241	192	166

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	CDI
2020	-0,78%	-2,39%	0,67%	4,31%	5,24%	1,24%	1,48%	-1,01%	-0,14%	-0,79%	-0,14%		7,67%	2,60%
2019	3,25%	-1,17%	1,16%	-0,48%	1,81%	3,87%	1,05%	0,45%	2,39%	1,19%	-1,69%	1,89%	14,44%	5,97%
2018	1,52%	0,85%	0,17%	1,10%	-0,76%	1,17%	2,41%	-0,03%	1,53%	1,89%	-3,12%	-0,73%	6,03%	6,42%
2017	2,71%	2,18%	1,74%	1,07%	-2,42%	0,73%	0,01%	1,23%	2,42%	0,72%	0,80%	0,57%	12,29%	9,93%
2016	1,95%	0,74%	1,03%	2,99%	1,43%	2,23%	0,97%	1,17%	1,96%	0,44%	-1,23%	1,64%	16,36%	14,00%

Análise estatística

% meses positivos	85,1%
% meses acima do CDI	58,8%
% meses acima de 150% do CDI	39,9%
maior retorno mensal	5,24%
menor retorno mensal	-3,12%

	Volatilidade	Sharpe
12 meses	9,25	0,73
24 meses	7,41	0,82
36 meses	6,37	0,69
48 meses	6,54	0,62
Início*	4,23	0,65

Informações

PL atual do fundo: R\$ 178.319.793,73.
 PL médio (12 meses): R\$ 197.023.547,29.
 PL da Estratégia: R\$ 1.139.799.391,52.
 Valor de aplicação inicial: R\$ 5.000,00.
 Valor mínimo de movimentação: R\$ 5.000,00.
 Saldo mínimo de permanência: R\$ 5.000,00.
 Aplicação: Cota D+0.
 Resgate: Cota D+0.
 Liquidação Financeira - Resgate: D+1 (útil) da data de conversão de cotas.
 Taxa de administração: 1,95% ao ano.
 Classificação Tributária: Longo prazo.

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

CNPJ: 03.804.917/0001-37

Código Anbima: 99589.

Categoria Anbima: Multimercados Macro.

Gestora: GAP Gestora de Recursos LTDA.

Administrador e distribuidor: BNY Mellon DTVM S.A.

Auditor: Deloitte Touche Tohmatsu Consultores Ltda.

Custodiante: BNY Mellon Banco S.A.