

GAP Multiportfolio FIC FIM

Agosto 2019

FECHADO PARA
NOVAS APLICAÇÕES (**)

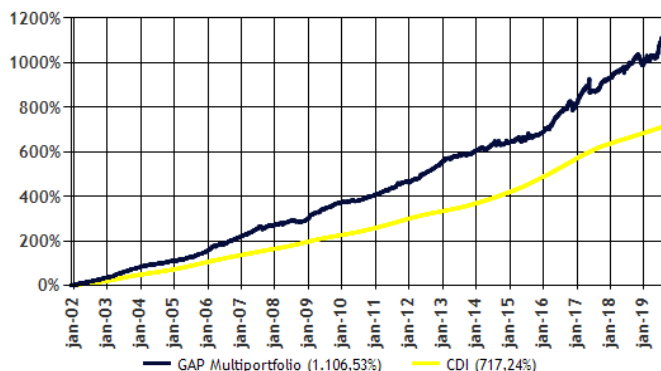
Objetivo: superar substancialmente a variação do CDI em qualquer período de 12 meses.

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 30/08/2019



Rentabilidades

Rentabilidades	Ago. 2019	Jul. 2019	Jun. 2019	Mai. 2019	Abr. 2019	Mar. 2019	Acum. 2019	Acum. 12 meses	Acum. 24 meses	Acum. Início(*)
GAP Multiportfolio	0,45%	1,05%	3,87%	1,81%	-0,48%	1,16%	10,29%	9,65%	22,30%	1.106,53%
CDI	0,50%	0,57%	0,47%	0,54%	0,52%	0,47%	4,18%	6,31%	13,58%	717,24%
Em % do CDI	89,84%	185,66%	826,25%	333,82%	—	248,25%	245,97%	153,04%	164,20%	154,28%

Média do PL nos últimos 12 meses: R\$ 211.982.876

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	20,66
Menor retorno mensal	-3,12%	-631,50%	Meses entre 50% e 100% do CDI	42	19,72
Volatilidade Histórica	últ. 12 meses		Meses entre 100% e 150% do CDI	44	20,66
Volatilidade	5,06%		Meses acima de 150% do CDI	83	38,97
VaR diário médio	0,59%		Total	213	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.

Conta-corrente para TED:

BNY MELLON BANCO S.A. - 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 Macro.

