

GAP Multiportfolio FIM

Novembro 2018

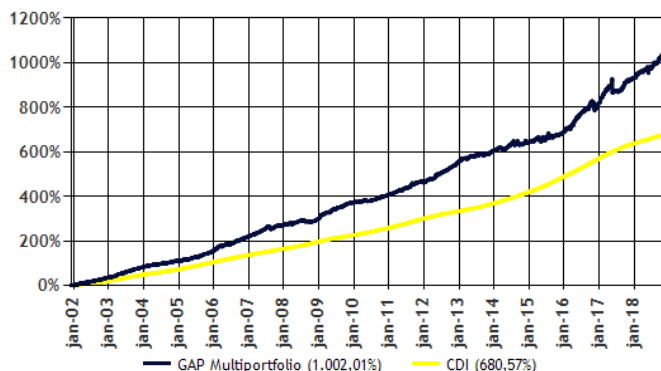
Objetivo: superar substancialmente a variação do CDI em qualquer período de 12 meses.

Política de Investimento: consiste em 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 30/11/2018



Rentabilidades

Rentabilidades	Nov. 2018	Out. 2018	Set. 2018	Ago. 2018	Jul. 2018	Jun. 2018	Acum. 2018	Acum. 12 meses	Acum. 24 meses	Acum. Início(*)
GAP Multiportfolio	-3,12%	1,89%	1,53%	-0,03%	2,41%	1,17%	6,81%	7,42%	21,91%	1.002,01%
CDI	0,49%	0,54%	0,47%	0,57%	0,54%	0,52%	5,90%	6,47%	17,72%	680,57%
Em % do CDI	-	347,24%	325,81%	-	443,94%	225,99%	115,42%	114,72%	123,65%	147,23%

Média do PL nos últimos 12 meses: R\$ 152.665.910

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	41	20,10
Menor retorno mensal	-3,12%	-631,50%	Meses entre 50% e 100% do CDI	41	20,10
Volatilidade Histórica	últ. 12 meses		Meses entre 100% e 150% do CDI	44	21,57
Volatilidade	3,43%		Meses acima de 150% do CDI	78	38,24
VaR diário médio	0,42%		Total	204	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 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: 2,00% 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.

