

GAP Absoluto FIC FIM

Dezembro 2018

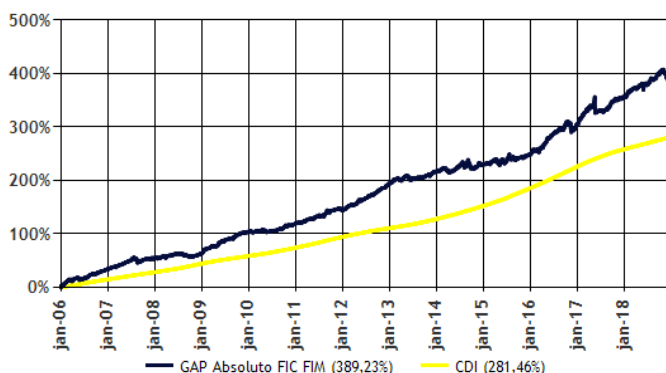
Objetivo: superar substancialmente a variação do CDI em qualquer período de 12 meses.

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 30/12/2005 a 31/12/2018



Rentabilidades

Rentabilidades	Dez. 2018	Nov. 2018	Out. 2018	Set. 2018	Ago. 2018	Jul. 2018	Acum. 2018	Acum. 12 meses	Acum. 24 meses	Acum. Início(*)
GAP Absoluto FIC FIM	-0,58%	-3,06%	1,93%	1,55%	-0,09%	2,58%	7,23%	7,23%	20,68%	389,23%
CDI	0,49%	0,49%	0,54%	0,47%	0,57%	0,54%	6,42%	6,42%	16,98%	281,46%
Em % do CDI	-	-	356,04%	331,39%	-	475,43%	112,60%	112,60%	121,76%	138,29%

Média do PL nos últimos 12 meses: R\$ 71.402.771

Análises Estatísticas

Análise Retornos	Retorno	Em % do CDI	Análise Retornos Mensais vs CDI	Nº meses	% s/total
Maior retorno mensal	8,08%	566,46%	Meses abaixo de 50% do CDI	41	26,28
Menor retorno mensal	-3,84%	-388,92%	Meses entre 50% e 100% do CDI	22	14,10
Volatilidade Histórica	últ. 12 meses		Meses entre 100% e 150% do CDI	20	12,82
Volatilidade	3,86%		Meses acima de 150% do CDI	73	46,79
VaR diário médio	0,44%		Total	156	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. - Agência: 0001-0 - C/C: 1341-2

GAP Absoluto FIC FIM - CNPJ: 01.823.373/0001-25

Aplicação: Cota D+0.

Resgate: Cota D+30 (corridos) com isenção de taxa de saída e Cota D+0 com taxa de saída de 5% sobre o valor resgatado.

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: KPMG Auditores Independentes.

Custodiante: BNY MELLON BANCO S.A.

Código Anbima: 109630.

Categoria Anbima: Multimercados Livre.

