

GAP Multiportfolio FIC FIM

Junho de 2020

Objetivo

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

Público alvo

Investidores em geral

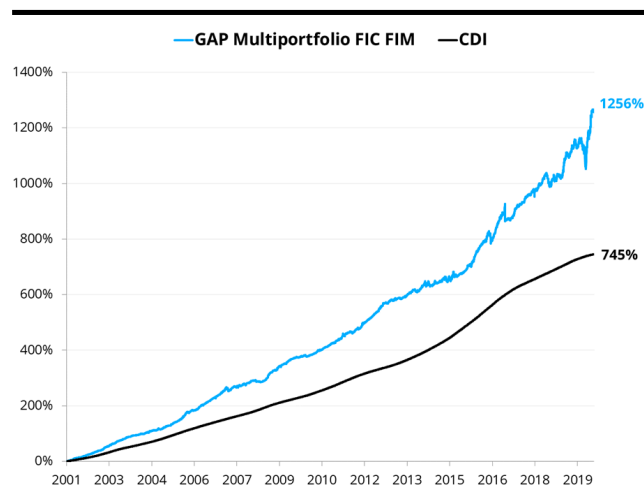
Grau de risco

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	1,24	8,34	14,13	26,29	39,19	1.256,48
% CDI	575,95	471,80	305,19	233,92	201,61	168,44

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%							8,34%	1,77%
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	86,6%
% meses acima do CDI	59,6%
% meses acima de 150% do CDI	40,4%
maior retorno mensal	5,24%
menor retorno mensal	-3,12%

	Volatilidade	Sharpe
12 meses	8,49	1,11
24 meses	6,86	1,01
36 meses	5,88	0,95
48 meses	6,39	0,60
Início*	4,13	0,70

Informações

PL atual do fundo: R\$ 200.084.414,46.

PL médio (12 meses): R\$ 208.446.501,97.

PL da Estratégia: R\$ 696.852.646,98.

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.



Material de divulgação. Este material tem caráter meramente informativo e não deve ser considerado uma oferta para compra de cotas do Fundo. A GAP não comercializa nem distribui quotas de fundos de investimentos ou qualquer outro ativo financeiro. Leia o Formulário de Informações Complementares, a Lâmina de informações essenciais e o Regulamento do Fundo antes de investir (disponíveis em <https://servicosfinanceiros.bnymellon.com/>). A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo garantidor de créditos - FGC. Este fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimentos. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Os fundos multimercados com renda variável podem estar expostos a significativa concentração em ativos de poucos emissores, com risco daí decorrentes. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior. Não há garantia de que este fundo terá tratamento tributário para fundos de longo prazo. Computando-se eventuais investimentos do Fundo em outros fundos, a taxa de administração poderá atingir no máximo 2,2 % a.a. sobre o patrimônio líquido do Fundo. (*)Data de início da gestão: 03/12/2001 - Data de início das atividades: 19/05/2000.