

GAP Multiportfolio 30 FIM

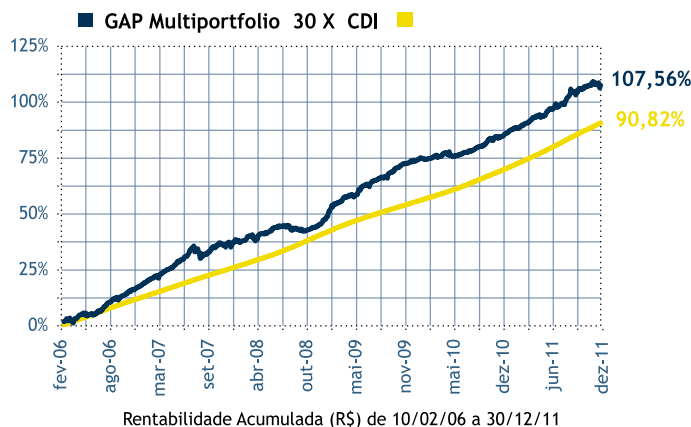
Dezembro 2011

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 sólida análises macro e micro-econômicas.

Grau de Risco: agressivo.

Público-alvo: investidores que buscam, no longo prazo, retornos superiores aos instrumentos convencionais de renda fixa.



Rentabilidades

Rentabilidades	Dez. 2011	Nov. 2011	Out. 2011	Set. 2011	Ago. 2011	Jul. 2011	Acum. 2011	Acum. 12 meses	Acum. 2010	Acum. 2009	Acum. Início(*)
GAP Multiportfolio 30	-0,86%	1,07%	0,99%	0,60%	2,17%	0,79%	10,82%	10,82%	7,47%	17,38%	107,56%
CDI	0,90%	0,86%	0,88%	0,94%	1,07%	0,97%	11,60%	11,60%	9,75%	9,88%	90,82%
em % do CDI	-	124,26%	112,83%	63,76%	202,50%	81,99%	93,35%	93,35%	76,64%	175,95%	118,44%

Média do PL nos últimos 12 meses: R\$ 143.247.262

Análises Estatísticas

Análise Retornos Mensais	Retorno	em % do CDI	Análise Retornos Mensais vs CDI	Nº meses	% s/total
Maior retorno mensal	3,76%	360,82%	Meses abaixo de 50% do CDI	14	20,00%
Menor retorno mensal	-1,67%	-169,28%	Meses entre 50% e 100% do CDI	18	25,71%
Volatilidade Histórica	últ. 12 meses		Meses entre 100% e 150% do CDI	14	20,00%
Volatilidade	2,52%		Meses acima de 150% do CDI	24	34,29%
VaR diário médio	0,21%		Total	70	100,00%

*VaR paramétrico com 95% de confiança e período de 1 dia.

Informações

Valor de aplicação inicial: R\$ 50 mil

Valor mínimo de movimentação: R\$ 5 mil

Saldo mínimo de permanência: R\$ 5 mil

Horário para movimentações: Até 14 h, com recursos disponíveis na conta do fundo. Movimentações para novos clientes: até 13 h.

Conta-corrente para TED: Bradesco - Ag. 2856-8 - C/C: 585.723-6

GAP Multiportfolio 30 FI Multimercado - CNPJ: 07.808.300/0001-40

Aquisição das cotas: Cota D+0

Resgate das cotas: Cota D+0 e pagamento de resgate em cota D+1

Liquidez: Diária

Taxa de Saída: 5% sobre o valor do resgate, revertendo ao Fundo.

Isonção de Taxa de Saída: não haverá cobrança de taxa de saída para solicitações com antecedência mínima de 30 dias corridos

Taxa de administração: 2,0% ao ano

Taxa de Performance: 25% sobre o ganho que exceder a variação do CDI - marca d'água

IOF: Até 29 dias a contar da data da aplicação

Imposto de Renda: 15% sobre o ganho nominal para permanência superior a 2 anos

Gestora: GAP Gestora de Recursos LTDA.

Tels: 21 2142-1940/2025-1196/2025-1197 / 11 3077-1900 / www.gapasset.com.br

Fax 21 2142-1957 / 11 3077-1923 / contato@gapasset.com.br

Administrador e Distribuidor:

BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. (CNPJ: 02.201.501/0001-61)

Av. Presidente Wilson, 231, 11º andar, Rio de Janeiro, RJ, CEP 20030-905

Telefone: (21) 3219-2998 Fax (21) 3974-4501 www.bnymellon.com.br/sf

SAC: sac@bnymellon.com.br ou (21) 3219-2600, (11) 3050-8010, 0800 725 3219

Ouidوريا: ouidوريا@bnymellon.com.br ou 0800 7253219

Custodiante: Banco Bradesco S.A.

Auditor: KPMG Auditores Independentes

Anbid:

Código: 155608

Categoria: Multimercado Multiestratégia