

CONCEITO DO FUNDO

O NEO MULTI ESTRATÉGIA é um fundo baseado principalmente em operações de arbitragem nos mercados locais de taxas de juros, câmbio e bolsa de valores, tanto no mercado à vista quanto nos seus derivativos. As operações direcionais deverão ter papel secundário no resultado do fundo, priorizando operações que não estejam relacionadas a movimentos específicos de mercado e buscando uma diversificação eficiente da carteira.

NEO MULTI ESTRATÉGIA FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO

C.N.P.J. 05.786.899/0001-33
Administração Intrag DTVM S.A.
Gestão NEO Investimentos
Distribuição Intrag DTVM S.A.
Custódia Banco Itaú
Auditoria Deloitte Touche Tohmatsu A. I.
Código ANBID 119369
Categoria Multimerc. c/ RV c/ Alavancagem

DADOS PARA MOVIMENTAÇÃO

Público Alvo Pessoas Físicas e Jurídicas que busquem retornos acima do CDI
Aplic. Mínima R\$ 25.000,00
Liquidez Diária
Aplicação Financeiro D+0
 Cotização D+1
Resgate Financeiro D+5
 Cotização D+4

REMUNERAÇÃO

Taxa de administração: 2,0% a.a. (provisionado diariamente e cobrado mensalmente).
Taxa de performance: 20% sobre o que exceder a variação do CDI (provisionado diariamente e cobrado semestralmente utilizando o conceito de linha d'água)

NEO Investimentos | São Paulo
 Av. Brigadeiro Faria Lima, 3144, cj 41
 Jardim Paulistano - CEP: 01451-000
 Tel: 11 2164 1100 Fax: 11 2164 1101

NEO Investimentos | Rio de Janeiro
 Rua Visconde de Pirajá, 414 - cj 1320/1321
 Ipanema - CEP: 22410-002
 Tel: 21 2522 6024 Fax: 21 2513 3253

neo@neoinvestimentos.com.br
 www.neoinvestimentos.com.br

Intrag DTVM S.A.
 Av. Eng. Armando de Arruda Pereira, 707
 7º andar - Conceição - CEP 04344-902
 São Paulo - SP Tel: 11 5029 1456

intrag@itau.com.br
 www.intrag.com.br

ANBID Prospecto de acordo com Código ANBID de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento

RENTABILIDADE E EXPOSIÇÃO A RISCO

	set 09	ago 09	jul 09	jun 09	mai 09	acum 2009	últ.6 meses	últ.12 meses	acum 2008	acum 2007	acum 2006	desde início*
Rentabilidade (1)	0,82	1,05	1,20	0,82	1,09	10,53	6,08	17,21	13,34	12,74	16,74	153,45
% CDI	118	152	153	109	142	138	131	154	108	108	111	118
Volatilidade (2)	1,20	0,70	1,25	1,24	1,69	2,06	1,41	2,64	3,58	3,33	2,44	2,40
Exp shortfall Risk (3)	2,53	1,99	1,88	1,84	1,70	1,75	1,88	1,58	1,42	1,77	1,28	1,30
Parâmetro	3,71	3,71	3,72	3,76	3,82	3,83	3,76	3,90	4,01	3,97	4,21	4,17
% parâmetro	68,05	53,51	50,38	48,90	44,60	45,62	50,08	40,42	35,51	44,66	30,28	31,13
P.L. médio (4)	97,84	98,23	98,96	98,56	98,41	99,18	98,30	102,62	217,26	455,32	420,44	296,98

(1) Rentabilidade bruta de impostos. (2) Volatilidade = desvio padrão dos retornos diários anualizados. (3) Os valores acima representam a média dos riscos diários calculada pelo conceito de "Expected Shortfall". Maiores detalhes sobre o método de cálculo podem ser obtidos no site. (4) P.L. médio em milhões de reais. *Início do fundo em 18 de agosto de 2003.

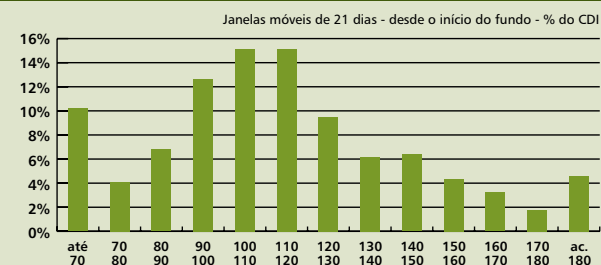
ATRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE

Contribuição: retorno absoluto.	set 09	acum 2009	desde início
Caixa	0,79%	7,76%	131,21%
Vol RV	0,14%	0,77%	7,82%
Vol Dolar	0,00%	0,00%	0,08%
Cash and Carry	0,00%	0,01%	2,00%
Long Short	0,04%	-0,65%	4,58%
Direc Dolar	0,10%	0,60%	1,53%
Direc Juros	0,03%	1,33%	1,45%
Direc Bolsa	-0,01%	0,13%	0,71%
Direc Offshore	-0,02%	-0,08%	-0,84%
Inflação	0,00%	0,01%	-0,92%
Curva DI	-0,09%	2,86%	6,32%
Curva Macro	0,00%	0,00%	0,13%
Custos	-0,21%	-2,33%	-13,42%
Outros	0,05%	0,12%	12,80%
Total	0,82%	10,53%	153,45%

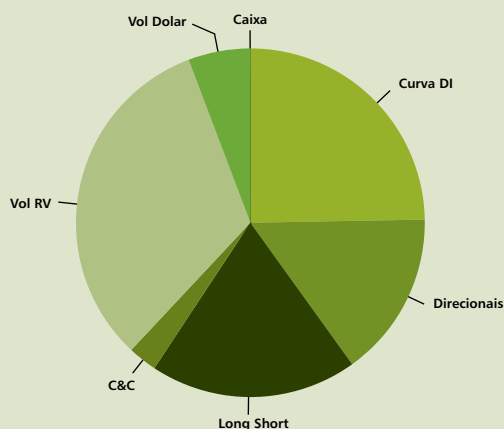
CAMPO DE CONSISTÊNCIA

Número de Meses Negativos: 2
Número de Meses Positivos: 72
 - Acima do CDI: 52
 - Abaixo do CDI: 20
Maior Retorno em Períodos de 21 Dias Úteis: 3,11%
Média de Retorno em Períodos de 21 Dias Úteis: 1,27%
Pior Retorno em Períodos de 21 Dias Úteis: -1,21%

DISTRIBUIÇÃO DOS RETORNOS

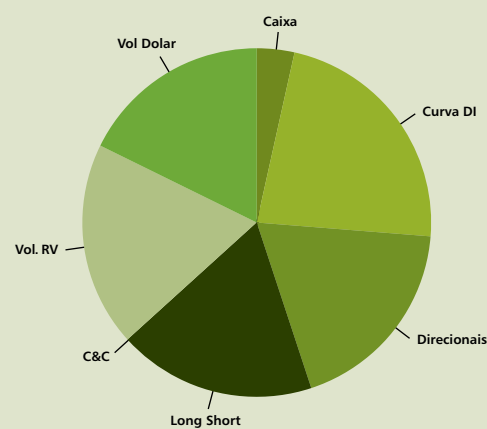


RETORNOS EXCESSIVOS ESPERADOS*



*Retorno esperado para cada estratégia com base no orçamento de risco definido.

RISCO ALOCADO DURANTE O MÊS*



*Risco calculado pelo conceito de "Expected Shortfall".

A NEO GESTÃO DE RECURSOS LTDA NÃO COMERCIALIZA NEM DISTRIBUI QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS OU QUALQUER OUTRO ATIVO FINANCEIRO. AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESTE MATERIAL SÃO DE CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO. NEO INVESTIMENTOS É A MARCA DE FANTASIA DA NEO GESTÃO DE RECURSOS LTDA. 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. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. AO INVESTIDOR É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA DO PROSPECTO E DO REGULAMENTO DO FUNDO DE INVESTIMENTO AO APLICAR SEUS RECURSOS. ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS COM DERIVATIVOS COMO PARTE INTEGRANTE DE SUA POLÍTICA DE INVESTIMENTO. TAIS ESTRATÉGIAS, DA FORMA COMO SÃO ADOTADAS, PODEM RESULTAR EM SIGNIFICATIVAS PERDAS PATRIMONIAIS PARA SEUS COTISTAS, PODENDO INCLUSIVE ACARREJAR PERDAS SUPERIORES AO CAPITAL APLICADO E A CONSEQUENTE OBRIGAÇÃO DO COTISTA DE APORTAR RECURSOS ADICIONAIS PARA COBRIR O PREJUÍZO DO FUNDO. INÍCIO DO FUNDO EM 18 DE AGOSTO DE 2003.