

SAFRA MAXWELL MACRO FIC FI MULTIMERCADO

Relatório Gerencial - Setembro de 2021

QAT - 26.305.892/0001-22



Safra

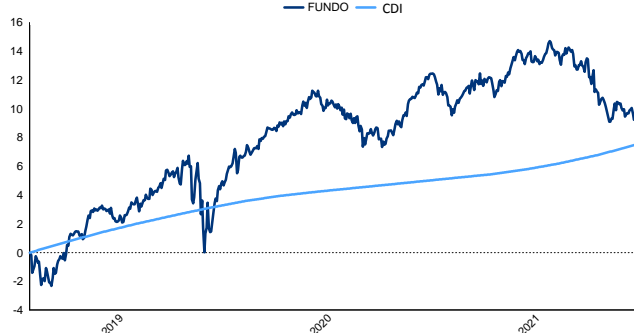
Descrição do Fundo

Fundo multimercado macro no qual as estratégias são implementadas através de modelos quantitativos e algoritmos sob a supervisão de profissionais experientes. Atua nos mercados de juros, câmbio, bolsa e utilizando instrumentos derivativos, para hedge, posição e alavancagem da carteira, em busca de ganhos significativamente superiores ao CDI no médio/longo prazo.

Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses(milhões)	R\$ 1.484,28
Categoria ANBIMA	Multimercados Livre
Data Início	01/08/2019
Tributação	Longo Prazo conforme Tabela Regressiva.
Aplicação Inicial	R\$ 5.000,00
Movimentação	R\$ 500,00
Saldo Mínimo	R\$ 100,00
Horário	09:01 às 15:00
Taxa de Administração	2,00% a.a.
Taxa de Performance	20,00%
Cotas de Aplicação	D+1
Cota Conversão Resgate	D+31
Pagamento Resgate	D+32

Rentabilidade (%) - Fundo x CDI



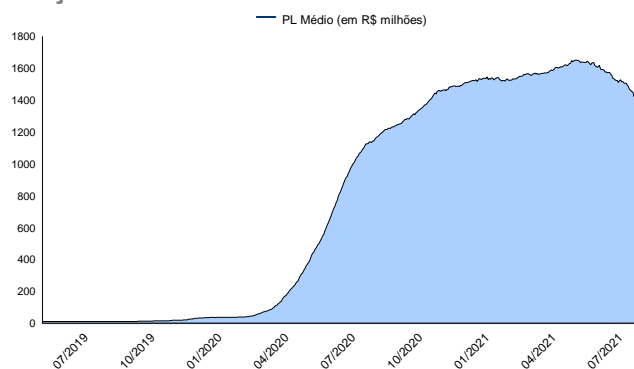
Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	10,69 %	7,66 %	137,59 %	6,07 %
12 meses	1,72 %	2,99 %	57,95 %	4,85 %
24 meses	9,10 %	6,65 %	135,14 %	5,99 %
36 meses	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %

	Melhores Retornos	Piores Retornos
Mensal	2,67 %	-2,59 %
12 meses	12,93 %	-1,38 %
Período em relação ao CDI	57,69 %	42,31 %

% Meses Acima do CDI % Meses Abaixo do CDI

Evolução PL Médio



Rentabilidade Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2019	-	-	-	-	-	-	-	-1,07 %	2,56 %	1,50 %	-0,38 %	1,11 %	3,74 %
CDI	-	-	-	-	-	-	-	0,48 %	0,47 %	0,48 %	0,38 %	0,38 %	2,20 %
2020	1,46 %	-1,32 %	0,74 %	1,90 %	1,35 %	1,01 %	1,86 %	-1,03 %	-1,10 %	-1,20 %	1,87 %	2,67 %	8,39 %
CDI	0,38 %	0,29 %	0,34 %	0,28 %	0,24 %	0,22 %	0,19 %	0,16 %	0,16 %	0,16 %	0,15 %	0,16 %	2,77 %
2021	-2,41 %	1,45 %	0,63 %	1,24 %	0,42 %	0,21 %	-2,59 %	-0,76 %	0,34 %	-	-	-	-1,55 %
CDI	0,15 %	0,13 %	0,20 %	0,21 %	0,27 %	0,30 %	0,36 %	0,42 %	0,44 %	-	-	-	2,51 %

LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. O FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DA ADMINISTRADORA DO FUNDO, DA GESTORA 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. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA DISPONÍVEL NO FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. O Fundo utiliza estratégias que 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. O Fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para o Fundo e, conseqüentemente, para os seus cotistas. Este fundo está autorizado a realizar diretamente e/ou por meio de fundos investidos aplicações em ativos financeiros negociados no exterior. O fundo e/ou os fundos de investimentos que o fundo investe estão sujeitos ao risco de perda substancial de seu patrimônio líquido, em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo. Administrador do fundo: SAFRA SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

SAFRA MAXWELL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO.



SAFRA MAXWELL MACRO FIC FI MULTIMERCADO

Relatório Gerencial - Setembro de 2021

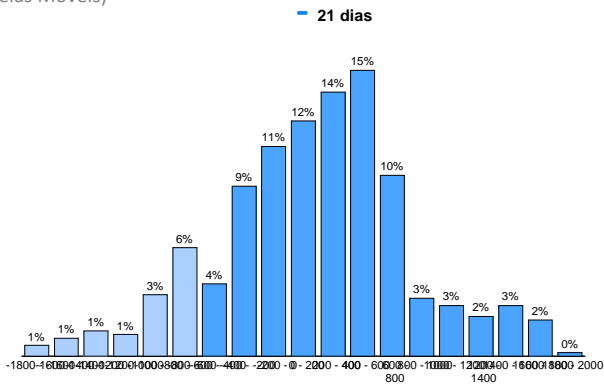
QAT - 26.305.892/0001-22



Safra

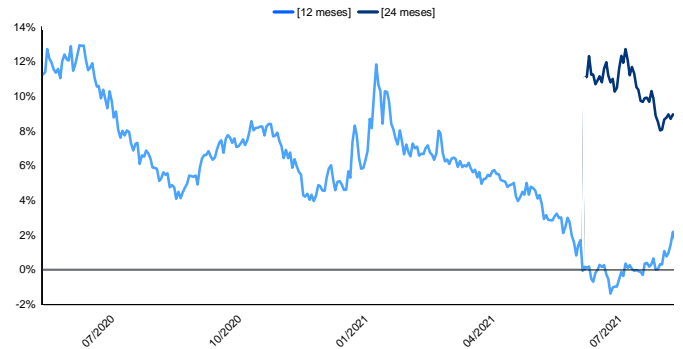
Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



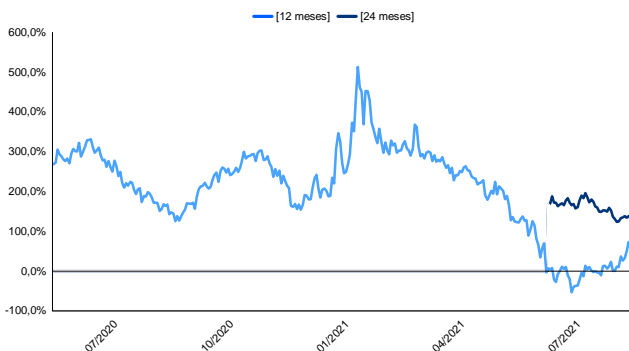
Retorno Nominal Anualizado

(Janelas Móveis)



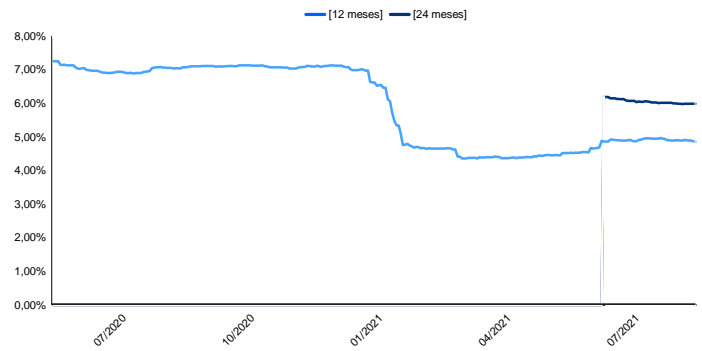
Retorno % CDI

(Janelas Móveis)



Volatilidade Anualizada

(Janelas Móveis)



LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. O FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DA ADMINISTRADORA DO FUNDO, DA GESTORA 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. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. DESCRIÇÃO DO TIPO ANBIMA DISPONÍVEL NO FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. O Fundo utiliza estratégias que 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. O Fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para o Fundo e, conseqüentemente, para os seus cotistas. Este fundo está autorizado a realizar diretamente e/ou por meio de fundos investidos aplicações em ativos financeiros negociados no exterior. O fundo e/ou os fundos de investimentos que o fundo investe estão sujeitos a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido, em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo. Administrador do fundo: SAFRA SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA. SAFRA MAXWELL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO.

