RWA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

RWA - 32.398.353/0001-88

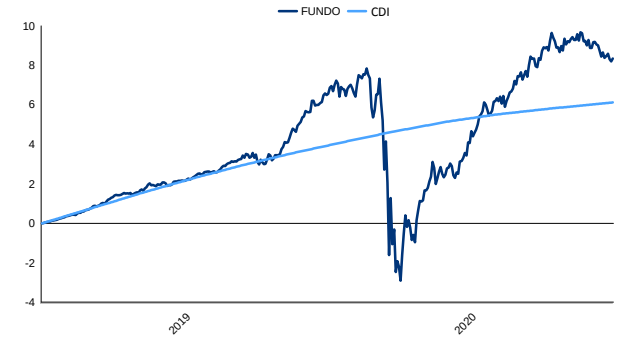
Safra

Descrição do Fundo

Características do Fundo

Patrimonio Liquido 12 Meses	R$ 34,21
Categoria ANBIMA	Multimercado Investimento no Exterior
Data Início	07/05/2019
Aplicação Inicial	R$ 0,00
Movimentação	R$ 0,00
Saldo Mínimo	R$ 0,00
Horário	09:01 às 15:00
Taxa de Administração	Alíquota: 0,20% a.a.
Cotas de Aplicação	D+0
Cota Conversão Resgate	D+0
Pagamento Resgate	D+1

Rentabilidade (%) - Fundo x CDI

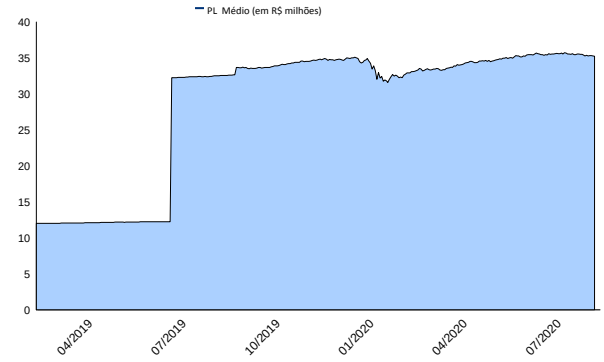


Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	8,34 %	6,12 %	134,92 %	7,06 %
12 meses	5,58 %	3,56 %	155,27 %	8,37 %
24 meses	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
36 meses	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %

	Melhores Retornos	Piores Retornos
Mensal	2,73 %	-5,61 %
12 meses	7,54 %	2,17 %
Período em relação ao CDI	68,75 %	31,25 %
	% Meses Acima do CDI	% Meses Abaixo do CDI

Evolução PL Médio (12 meses)



Rentabilidade Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2013	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2019	-	-	-	-	**0,42 %**	**0,58 %**	**0,52 %**	**0,56 %**	**0,51 %**	**0,68 %**	**0,12 %**	**2,12 %**	**5,64 %**
CDI	-	-	-	-	0,44 %	0,47 %	0,57 %	0,50 %	0,47 %	0,48 %	0,38 %	0,38 %	3,75 %
2020	**0,77 %**	**-0,70 %**	**-5,61 %**	**2,73 %**	**2,03 %**	**1,72 %**	**2,33 %**	**0,37 %**	**-0,84 %**	-	-	-	**2,56 %**
CDI	0,38 %	0,29 %	0,34 %	0,28 %	0,24 %	0,22 %	0,19 %	0,16 %	0,16 %	-	-	-	2,29 %

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. Este fundo pode estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. 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. Este fundo está autorizado a realizar diretamente e/ou por meio de fundos investidos aplicações em ativos financeiros negociados no exterior. O fundo poderá comprar cotas de fundos de investimento que cobram taxa de performance. 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 SERVICOS DE ADMINISTRACAO FIDUCIARIA LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234, de 2ª a 6ª-feira, das 9 às 19h, exceto feriados.

Atendimento aos portadores de necessidades especiais, auditivas e fala. SAC Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana.

Ouvidoria caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236, de 2ª a 6ª-feira, das 9h às 18h, exceto feriados.

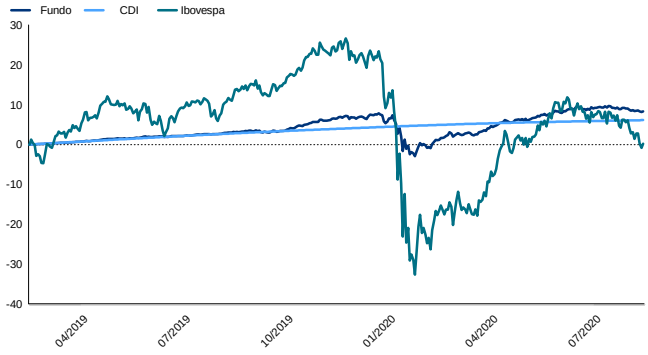
ANBIMA A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

RWA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

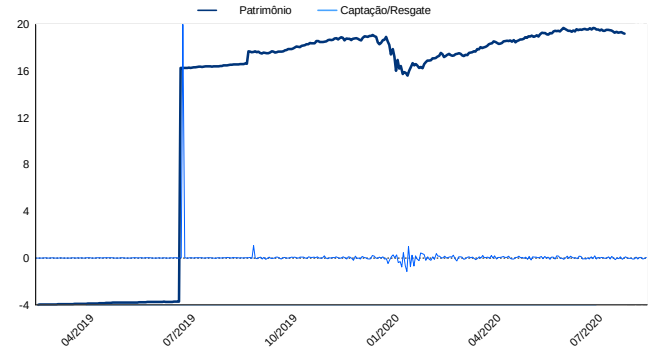
RWA - 32.398.353/0001-88

Rentabilidade (%) - Fundo X CDI X Ibovespa



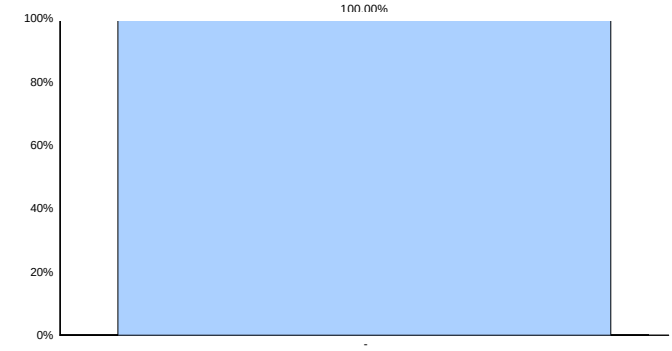
Captação / Resgates e Patrimônio

(R$ Milhões)



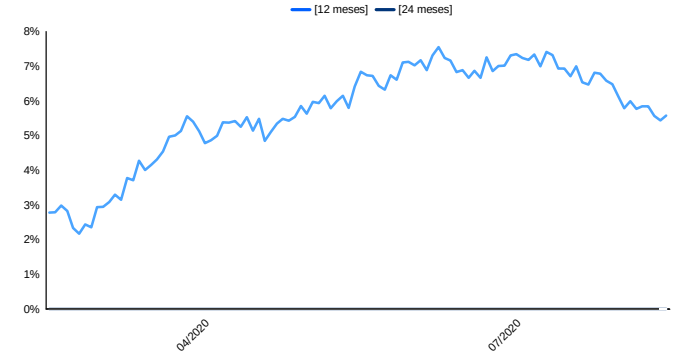
Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



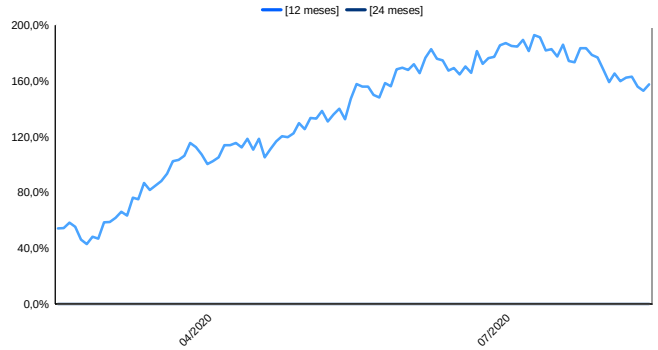
Retorno Nominal Anualizado

(Janelas Móveis)



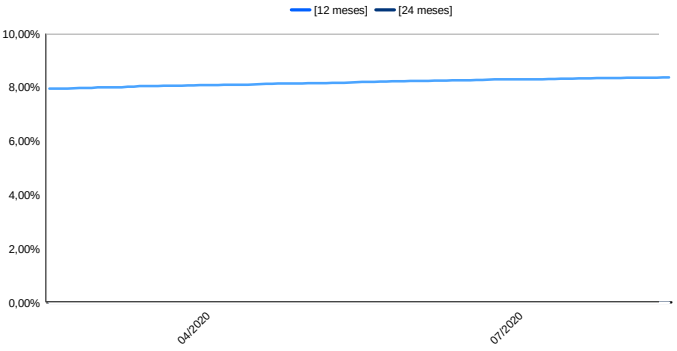
Retorno % CDI

(Janelas Móveis)



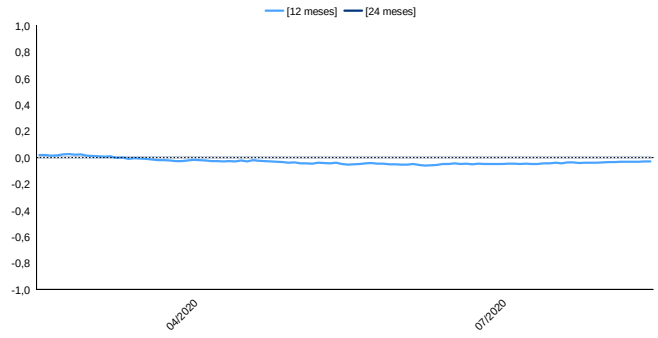
Volatilidade Anualizada

(Janelas Móveis)



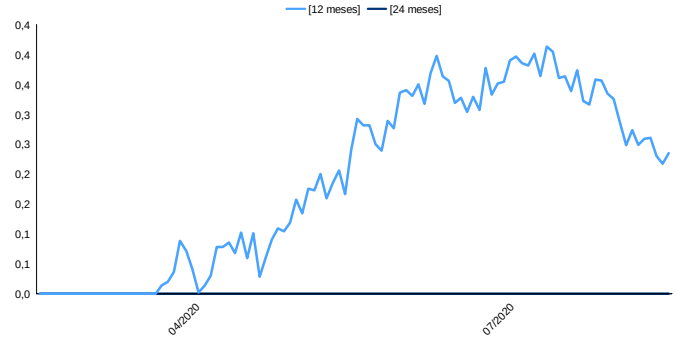
Correlação Fundos x Ibovespa

(Janelas Móveis)



Índice de Sharpe Anualizado

(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. Este fundo pode estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. 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. Este fundo está autorizado a realizar diretamente e/ou por meio de fundos investidos aplicações em ativos financeiros negociados no exterior. O fundo poderá comprar cotas de fundos de investimento que cobram taxa de performance. 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 SERVICOS DE ADMINISTRACAO FIDUCIARIA LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234, de 2ª a 6ª-feira, das 9 às 19h, exceto feriados.

Atendimento aos portadores de necessidades especiais, auditivas e fala. SAC Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana.

Ouvidoria caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236, de 2ª a 6ª-feira, das 9h às 18h, exceto feriados.

RWA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

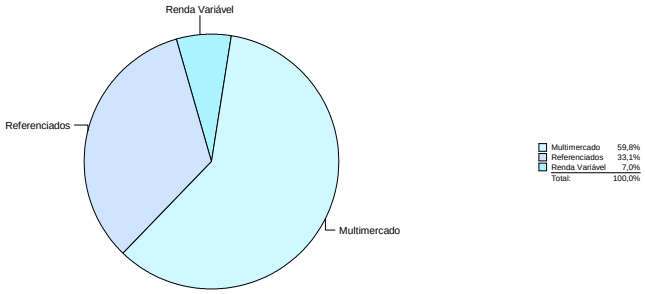
RWA - 32.398.353/0001-88

Ativos	%PL	R$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			09/2020	2020	12 meses	24 meses			
(1) SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	26,86%	9.472	0,03%	2,00%	3,22%	9,50%	0,09%	D+0	Referenciados
(2) MANAGER SPX NIMITZ FIC MULTIMERCADO	6,12%	2.157	-0,14%	5,27%	5,98%	6,25%	5,69%	D+61	Multimercado
(3) MANAGER KAPITALO KAPPA FIC MULTIMERCAD	5,92%	2.087	-1,67%	-5,42%	-1,73%	4,50%	10,48%	D+31	Multimercado
(4) SAFRA GALILEO ALOC FICFI MULTIMERCADO	5,91%	2.085	-1,65%	2,73%	5,55%	14,79%	6,75%	D+32	Multimercado
(5) MAN ABSOLUTE VERTEX S FIC FIM	5,89%	2.077	-1,41%	0,73%	4,30%	-	4,60%	D+30	Multimercado
(6) MANAGER ADAM MACRO FIC MULTIMERCADO	5,72%	2.017	-1,65%	1,83%	1,27%	9,49%	3,91%	D+31	Multimercado
(7) MANAGER VERDE FIC FI MULTIMERCADO	5,66%	1.995	-1,24%	-1,92%	0,76%	14,04%	16,46%	D+60	Multimercado
(8) MANAGER OCEANA LONG B FIC MULTIMERCAD	5,45%	1.923	-2,22%	-8,63%	-0,20%	35,83%	30,55%	D+32	Multimercado
(9) MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	5,36%	1.889	0,24%	17,84%	19,36%	35,29%	6,03%	D+91	Multimercado
(10) MANAGER ABSOLUTO PARTNERS II FIC FIA	5,22%	1.840	-1,07%	30,49%	-	-	44,69%	D+62	Renda Variável
MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	5,06%	1.783	-1,54%	4,74%	7,33%	-	10,27%	D+31	Multimercado
MANAGER ARGO LONG AND SHORT I FCIFI MM	4,83%	1.704	-0,26%	4,46%	6,24%	11,71%	6,36%	D+31	Multimercado
SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	4,07%	1.435	-0,51%	5,64%	7,81%	-	6,61%	D+1	Referenciados
MANAGER TRUXT LONG SHORT FC MULTIMERC	2,87%	1.012	-1,55%	11,65%	13,94%	25,42%	5,40%	D+32	Multimercado
SAFRA CREDIT OPPORTUNITIES FI RENDA FIXA	2,21%	780	0,26%	-	-	-	1,24%	D+16	Referenciados
MANAGER ATMOS FIC FI ACOES	1,83%	644	-2,38%	-5,56%	6,52%	81,95%	47,85%	D+62	Renda Variável
MANAGER JSS SUSTAINABLE EQUITY GLOBAL TH	1,03%	363	-4,27%	-	-	-	27,62%	D+3	Multimercado
CAIXA	-0,01%	-5	-	-	-	-	-	D+0	-

Indicadores					
CDI	0,16 %	2,29 %	3,56 %	10,06 %	0,07 %
IBOVESPA	-4,80 %	-18,20 %	-9,68 %	19,23 %	44,12 %

* Volatilidade anualizada de 12 meses ou desde o início do fundo, caso ele não possua 12 meses de existência.

Participação por Estratégia



Liquidez da Carteira

	Ativos	%	R$(mil)
Até D+0	2	26,85	R$ 9.467,29
Até D+1	3	30,92	R$ 10.902,15
Até D+3	4	31,95	R$ 11.265,56
Até D+16	5	34,16	R$ 12.045,75
Até D+30	6	40,05	R$ 14.123,20
Até D+31	10	61,59	R$ 21.715,81
Até D+32	13	75,83	R$ 26.736,71
Até D+60	14	81,48	R$ 28.731,59
Até D+61	15	87,60	R$ 30.888,56
Até D+62	17	94,64	R$ 33.372,40
Até D+91	18	100,00	R$ 35.261,07

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. Este fundo pode estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. 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. Este fundo está autorizado a realizar diretamente e/ou por meio de fundos investidos aplicações em ativos financeiros negociados no exterior. O fundo poderá comprar cotas de fundos de investimento que cobram taxa de performance. 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 SERVICOS DE ADMINISTRACAO FIDUCIARIA LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234, de 2ª a 6ª-feira, das 9 às 19h, exceto feriados.

Atendimento aos portadores de necessidades especiais, auditivas e fala. SAC Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana.

Ouvidoria caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236, de 2ª a 6ª-feira, das 9h às 18h, exceto feriados.

RWA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

RWA - 32.398.353/0001-88

Safra

Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
20/jul	Aplic.	SAFRA CAMB ALOCACAO FI MULTIMERCADO	190.000	OK
22/jul	Resg.	SAFRA CAMB ALOCACAO FI MULTIMERCADO	TOTAL	Liquidado
22/jul	Aplic.	MANAGER JSS SUSTAINABLE EQUITY GLOBAL TH	350.000	OK
22/jul	Resg.	MANAGER TRUXT LONG SHORT FC MULTIMERCA	1.120.000	Liquidado
22/jul	Resg.	MANAGER TORK FIC FI ACOES	TOTAL	Liquidado
13/ago	Resg.	MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	90.000	Carencia
17/ago	Aplic.	SAFRA SHORT INDEX ALOCACÃO FI MULTIMERCA	140.000	OK
28/ago	Resg.	MANAGER ABSOLUTO PARTNERS II FIC FIA	810.000	Carencia
28/ago	Aplic.	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	9.328.830	OK
2/set	Resg.	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	6.216	Liquidado
11/set	Resg.	MANAGER OCEANA LONG B FIC MULTIMERCADO	1.020.000	Carencia
17/set	Resg.	MANAGER ABSOLUTO PARTNERS II FIC FIA	310.000	Carencia
28/set	Resg.	SAFRA SHORT INDEX ALOCACÃO FI MULTIMERCA	TOTAL	Liquidado
29/set	Aplic.	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	152.110	OK
30/set	Resg.	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	5.529	Liquidado

Matriz de Correlação - 10 Ativos Mais Alocados

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
(1)	1,00									
(2)	-0,02	1,00								
(3)	0,02	0,48	1,00							
(4)	0,05	0,40	0,72	1,00						
(5)	0,07	0,37	0,71	0,68	1,00					
(6)	0,10	0,10	0,25	0,24	0,19	1,00				
(7)	-0,02	0,29	0,61	0,50	0,60	0,18	1,00			
(8)	-	0,34	0,65	0,61	0,57	0,29	0,91	1,00		
(9)	0,03	0,11	0,04	-0,04	0,13	0,05	0,13	0,09	1,00	
(10)	-0,02	0,38	0,63	0,58	0,58	0,18	0,90	0,94	0,15	1,00

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. Este fundo pode estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes. 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. Este fundo está autorizado a realizar diretamente e/ou por meio de fundos investidos aplicações em ativos financeiros negociados no exterior. O fundo poderá comprar cotas de fundos de investimento que cobram taxa de performance. 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 SERVICOS DE ADMINISTRACAO FIDUCIARIA LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

ANBIMA A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234, de 2ª a 6ª-feira, das 9 às 19h, exceto feriados.

Atendimento aos portadores de necessidades especiais, auditivas e fala. SAC Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana.

Ouvidoria caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236, de 2ª a 6ª-feira, das 9h às 18h, exceto feriados.