

AMELINA FICFI MM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

AML - 26.362.535/0001-04



Safra

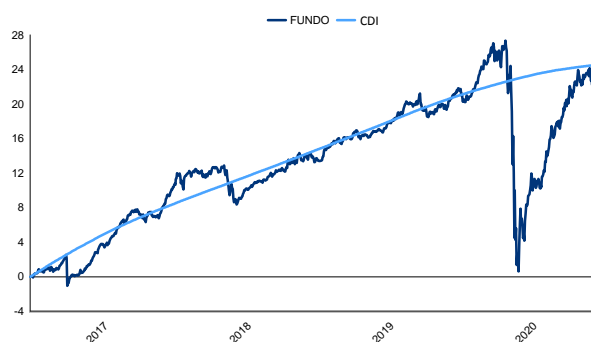


Descrição do Fundo

Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses	R\$ 11,13
Categoria ANBIMA	Multimercado Investimento no Exterior
Data Início	20/02/2017
Tributação	Longo Prazo conforme Tabela Regressiva.
Aplicação Inicial	R\$ 0,00
Movimentação	R\$ 0,00
Saldo Mínimo	R\$ 0,00
Horário	10:01 às 16:30
Taxa de Administração	0,15% a.a.
Cotas de Aplicação	D+0
Cota Conversão Resgate	D+0
Pagamento Resgate	D+1

Rentabilidade (%) - Fundo x CDI



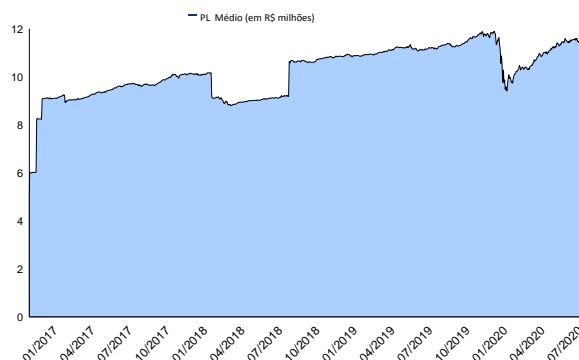
Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	20,69 %	24,63 %	85,42 %	9,24 %
12 meses	0,57 %	3,56 %	16,23 %	16,40 %
24 meses	7,40 %	10,06 %	74,46 %	11,80 %
36 meses	13,22 %	17,39 %	77,45 %	9,87 %

	Melhores Retornos	Piores Retornos
Mensal	4,47 %	-13,03 %
12 meses	12,98 %	-13,48 %
Período em relação ao CDI	53,49 %	46,51 %

% 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	-	-0,07 %	1,00 %	0,07 %	-0,75 %	0,78 %	2,41 %	1,34 %	1,68 %	0,61 %	-0,20 %	1,36 %	8,49 %
CDI	-	0,19 %	1,05 %	0,79 %	0,93 %	0,81 %	0,80 %	0,80 %	0,64 %	0,65 %	0,57 %	0,54 %	8,04 %
2018	3,09 %	0,09 %	-0,10 %	0,63 %	-2,48 %	-0,01 %	1,06 %	0,61 %	0,72 %	1,54 %	0,15 %	-0,32 %	5,00 %
CDI	0,58 %	0,47 %	0,53 %	0,52 %	0,52 %	0,52 %	0,54 %	0,57 %	0,47 %	0,54 %	0,49 %	0,49 %	6,42 %
2019	1,72 %	0,10 %	0,26 %	0,48 %	0,84 %	1,06 %	0,68 %	-0,66 %	0,77 %	1,23 %	-0,51 %	2,62 %	8,89 %
CDI	0,54 %	0,49 %	0,47 %	0,52 %	0,54 %	0,47 %	0,57 %	0,50 %	0,47 %	0,48 %	0,38 %	0,38 %	5,97 %
2020	0,82 %	-2,61 %	-13,03 %	4,47 %	3,15 %	3,30 %	3,76 %	0,71 %	-2,05 %	-	-	-	-2,69 %
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 exposto 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. 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.



AMELINA FICFI MM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

AML - 26.362.535/0001-04



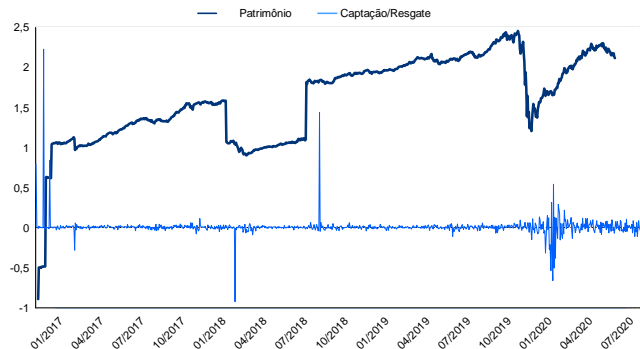
Safra

Rentabilidade (%) - Fundo X CDI X Ibovespa



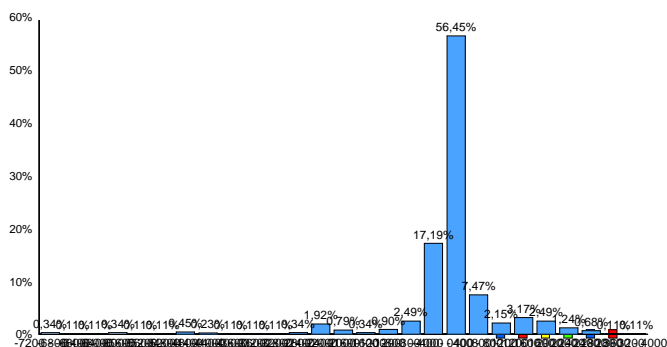
Captação / Resgates e Patrimônio

(R\$ Milhões)



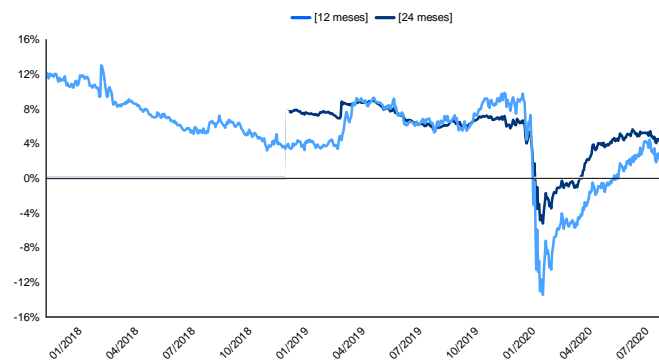
Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



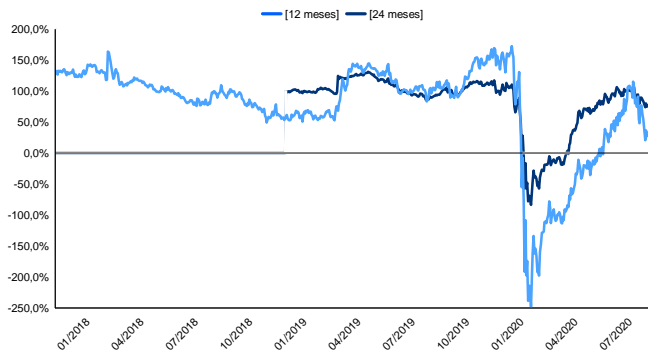
Retorno Nominal Anualizado

(Janelas Móveis)



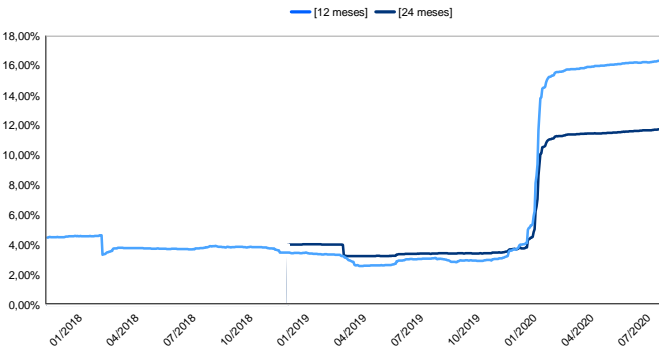
Retorno % CDI

(Janelas Móveis)



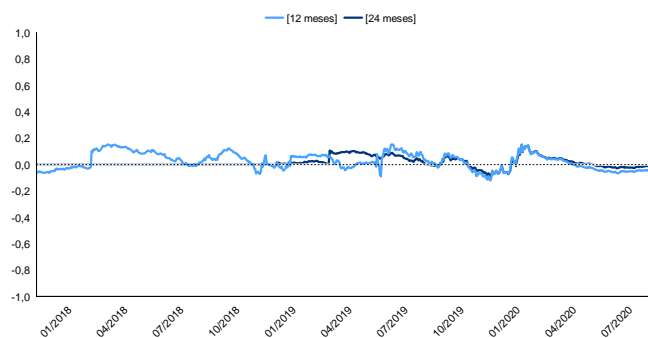
Volatilidade Anualizada

(Janelas Móveis)



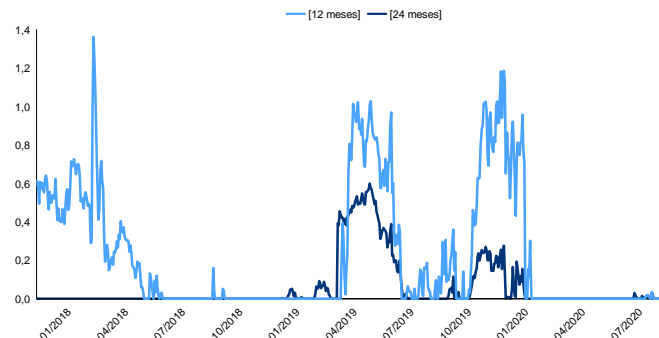
Correlação Fundos x Ibovespa

(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 exposto 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. 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.



AMELINA FICFI MM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

AML - 26.362.535/0001-04



Safra

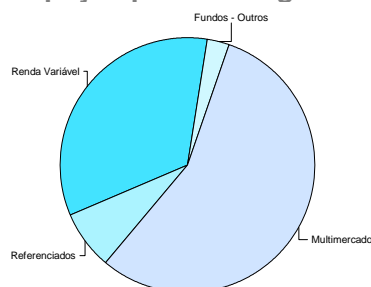
Ativos	%PL	R\$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			09/2020	2020	12 meses	24 meses			
(1) MANAGER SPX NIMITZ FIC MULTIMERCADO	8,42%	951	-0,14%	5,27%	5,98%	6,25%	-	D+61	Multimercado
(2) MANAGER VERDE FIC FI MULTIMERCADO	8,19%	924	-1,24%	-1,92%	0,76%	14,04%	-	D+60	Multimercado
(3) MANAGER ADAM MACRO FIC MULTIMERCADO	7,73%	872	-1,65%	1,83%	1,27%	9,49%	-	D+31	Multimercado
(4) MANAGER ABSOLUTO PARTNERS II FIC FIA	6,25%	705	-1,07%	30,49%	-	-	-	D+62	Renda Variável
(5) SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	6,04%	681	-0,51%	5,64%	7,81%	-	-	D+1	Referenciados
(6) MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	5,83%	658	-1,54%	4,74%	7,33%	-	-	D+31	Multimercado
(7) MAN ABSOLUTE VERTEX S FIC FIM	5,42%	612	-1,41%	0,73%	4,30%	-	-	D+30	Multimercado
(8) SAFRA GALILEO PB FIC MULTIMERCADO	5,40%	609	-1,64%	2,70%	5,51%	14,75%	-	D+32	Multimercado
(9) MANAGER CONSTELLATION FIC FI AÇÕES	4,94%	558	-3,95%	-	-	-	-	D+62	Renda Variável
(10) MANAGER KAPITALO ZETA FIC MULTIMERCADO	4,83%	545	-3,09%	-11,28%	-5,88%	1,37%	-	D+61	Multimercado
MANAGER TORK 60 S FIC FI ACOES	4,36%	493	-5,19%	-16,63%	-	-	-	D+62	Renda Variável
MANAGER ATMOS FIC FI ACOES	3,91%	442	-2,38%	-5,56%	6,52%	81,95%	-	D+62	Renda Variável
MANAGER NUCLEO FIC FI ACOES	3,90%	440	-4,10%	2,09%	15,71%	-	-	D+92	Renda Variável
MANAGER VELT FIC FIA	3,85%	435	-3,64%	-0,85%	-	-	-	D+90	Renda Variável
MANAGER BRASIL CAPITAL FIC ACOES	3,54%	400	-4,68%	-15,69%	-1,78%	56,56%	-	D+32	Renda Variável
MANAGER SPX FALCON FIC ACOES	3,06%	345	-1,67%	-11,11%	-5,12%	13,40%	-	D+62	Renda Variável
MANAGER TRUXT LONG BIAS FIC MULTIMERCA	2,76%	311	-3,30%	27,86%	35,89%	56,75%	-	D+32	Multimercado
MANAGER BW GLOBAL RISK PREMIUM USD FIC F	2,65%	300	0,09%	-	-	-	-	D+45	-
MANAGER JSS SUSTAINABLE EQUITY GLOBAL TH	2,61%	294	-4,27%	-	-	-	-	D+3	Multimercado
MANAGER BAHIA MARAU FIC FI MULTIMERCAD	2,43%	274	-0,77%	-4,50%	-2,47%	-	-	D+31	Multimercado
MAN TRUX LONG BIAS S FIC FIM	2,35%	266	-3,27%	27,85%	35,87%	-	-	D+32	Multimercado
SAFRA PERFORMANCE II FI DI CRED PRIV	1,56%	176	0,18%	1,21%	2,15%	8,67%	-	D+0	Referenciados
CAIXA	-	-	-	-	-	-	-	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	1,55	R\$ 175,21
Até D+1	3	7,59	R\$ 856,55
Até D+3	4	10,19	R\$ 1.150,69
Até D+30	5	15,61	R\$ 1.762,64
Até D+31	8	31,59	R\$ 3.566,59
Até D+32	12	45,65	R\$ 5.152,94
Até D+45	13	48,30	R\$ 5.452,52
Até D+60	14	56,49	R\$ 6.376,58
Até D+61	16	69,73	R\$ 7.871,97
Até D+62	21	92,25	R\$ 10.414,04
Até D+90	22	96,10	R\$ 10.848,58
Até D+92	23	100,00	R\$ 11.288,86

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 exposto 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. 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.



AMELINA FICFI MM CP IE

Relatório Gerencial - Setembro de 2020

AML - 26.362.535/0001-04



Safra

Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
15/jul	Aplic.	MANAGER JSS SUSTAINABLE EQUITY GLOBAL TH	280.000	OK
17/jul	Aplic.	SAFRA CAMB ALOCACAO FI MULTIMERCADO	170.000	OK
17/jul	Resg.	SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	190.000	Liquidado
20/jul	Aplic.	SAFRA CAMB ALOCACAO FI MULTIMERCADO	170.000	OK
22/jul	Resg.	SAFRA CAMB ALOCACAO FI MULTIMERCADO	TOTAL	Liquidado
29/jul	Aplic.	MANAGER BW GLOBAL RISK PREMIUM USD FIC F	280.000	OK
17/ago	Aplic.	SAFRA SHORT INDEX ALOCACAO FI MULTIMERCA	140.000	OK
8/set	Resg.	MANAGER BRASIL CAPITAL FIC ACOES	TOTAL	Carencia
8/set	Aplic.	MANAGER CONSTELLATION FIC FI AÇÕES	580.000	OK
8/set	Resg.	MANAGER TORK 60 S FIC FI ACOES	TOTAL	Carencia
25/set	Resg.	SAFRA SHORT INDEX ALOCACAO FI MULTIMERCA	TOTAL	Liquidado

Matriz de Correlação - 10 Ativos Mais Alocados

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
(1)	1,00									
(2)	0,29	1,00								
(3)	0,10	0,18	1,00							
(4)	0,38	0,90	0,18	1,00						
(5)	0,38	0,55	0,34	0,64	1,00					
(6)	0,42	0,68	0,22	0,72	0,77	1,00				
(7)	0,37	0,60	0,19	0,58	0,51	0,66	1,00			
(8)	0,40	0,50	0,24	0,58	0,76	0,73	0,68	1,00		
(9)	0,14	0,85	0,36	0,91	0,55	0,86	0,71	0,83	1,00	
(10)	0,48	0,61	0,26	0,63	0,66	0,80	0,73	0,73	0,71	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 exposto 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. 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.

