

CIZA FICFI MM CP INV EXT

Relatório Gerencial - Setembro de 2021

CIZ - 23.508.777/0001-67



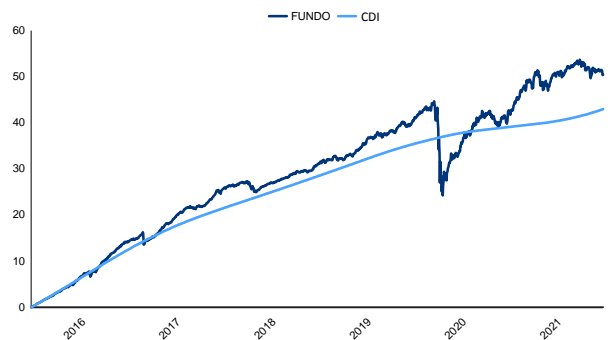
Safra

Descrição do Fundo

Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses(milhões)	R\$ 10,03
Categoria ANBIMA	Multimercados Investimento no Exterior
Data Início	25/04/2016
Tributação	Longo Prazo conforme Tabela Regressiva.
Aplicação Inicial	R\$ 1.000.000,00
Movimentação	R\$ 0,00
Saldo Mínimo	R\$ 0,00
Horário	10:01 às 15:00
Taxa de Administração	0,30% a.a.
Cotas de Aplicação	D+0
Cota Conversão Resgate	D+0
Pagamento Resgate	D+1

Rentabilidade (%) - Fundo x CDI

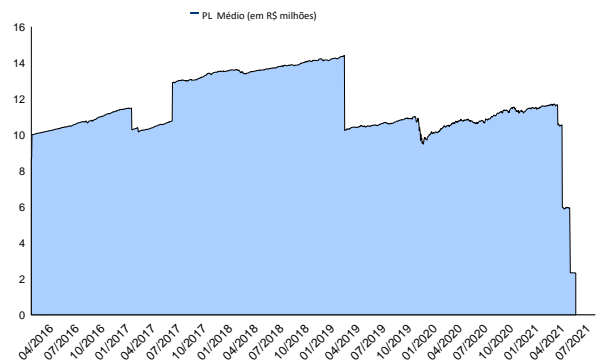


Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	50,50 %	43,02 %	114,25 %	5,30 %
12 meses	7,72 %	2,99 %	252,24 %	5,02 %
24 meses	8,73 %	6,65 %	129,90 %	8,25 %
36 meses	17,35 %	13,35 %	127,72 %	6,84 %

	Melhores Retornos	Piores Retornos
Mensal	3,24 %	-10,14 %
12 meses	18,65 %	-6,02 %
Período em relação ao CDI	61,54 %	38,46 %
	% 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
2014	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	0,20 %	1,10 %	1,06 %	1,04 %	1,22 %	1,23 %	1,38 %	0,63 %	1,79 %	10,06 %
CDI	-	-	-	0,21 %	1,11 %	1,16 %	1,11 %	1,21 %	1,11 %	1,05 %	1,04 %	1,12 %	9,49 %
2017	1,61 %	1,24 %	1,22 %	0,41 %	-0,33 %	0,94 %	1,85 %	1,25 %	1,22 %	0,67 %	0,18 %	0,82 %	11,63 %
CDI	1,09 %	0,87 %	1,05 %	0,79 %	0,93 %	0,81 %	0,80 %	0,80 %	0,64 %	0,65 %	0,57 %	0,54 %	9,95 %
2018	2,08 %	0,41 %	0,39 %	0,57 %	-1,11 %	0,16 %	0,75 %	0,49 %	0,58 %	0,97 %	0,23 %	0,22 %	5,87 %
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	1,40 %	0,07 %	0,17 %	0,59 %	0,86 %	1,15 %	0,76 %	0,72 %	0,54 %	1,15 %	-0,25 %	1,63 %	9,12 %
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	0,59 %	-1,38 %	-8,80 %	3,24 %	2,31 %	1,75 %	2,43 %	0,40 %	-1,55 %	0,08 %	3,20 %	2,64 %	4,35 %
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	-0,37 %	0,37 %	0,43 %	1,41 %	0,88 %	0,50 %	-0,95 %	-0,11 %	-0,54 %	-	-	-	1,62 %
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. 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. O fundo utiliza estratégias com derivativos para proteção da carteira. O Fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para o Fundo e, conseqüentemente, para os seus cotistas. Administrador do fundo: SAFRA SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.



CIZA FICFI MM CP INV EXT

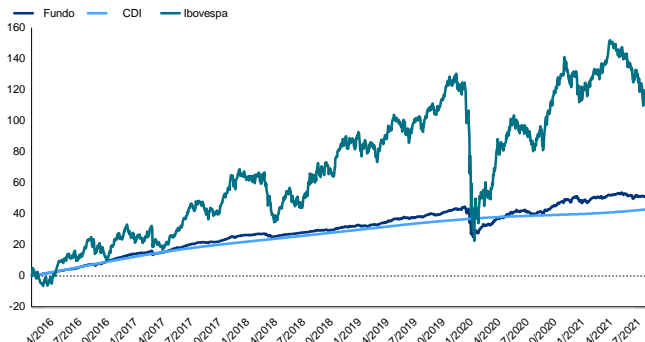
Relatório Gerencial - Setembro de 2021

CIZ - 23.508.777/0001-67



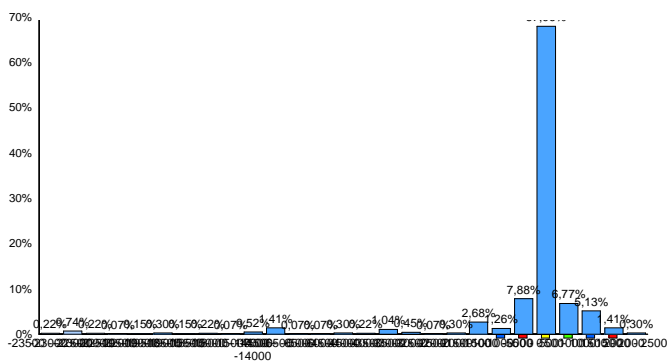
Safra

Rentabilidade (%) - Fundo X CDI X Ibovespa



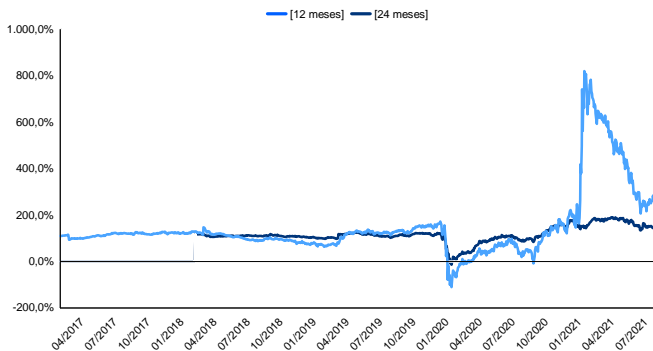
Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



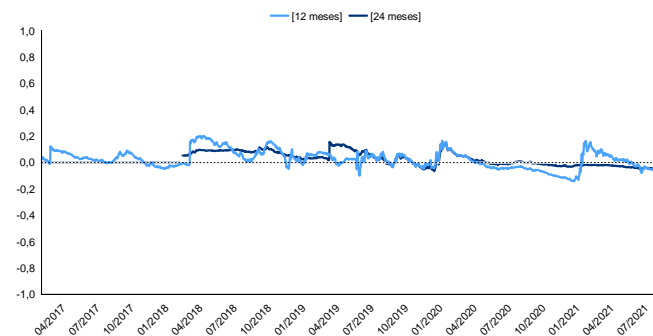
Retorno % CDI

(Janelas Móveis)



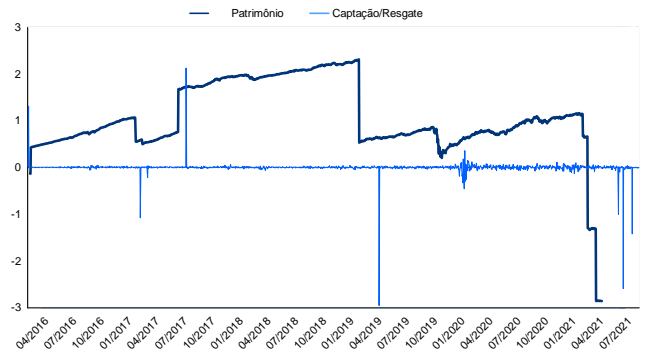
Correlação Fundos x Ibovespa

(Janelas Móveis)



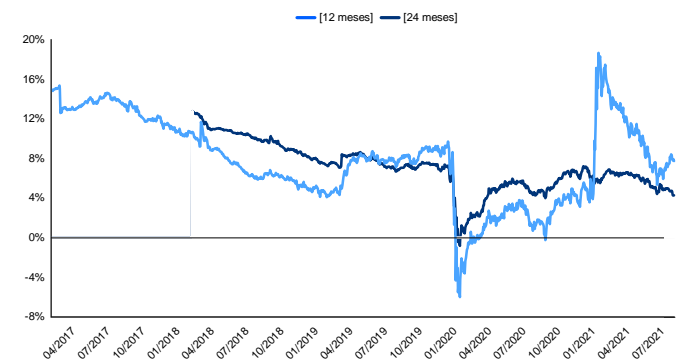
Captação / Resgates e Patrimônio

(R\$ Milhões)



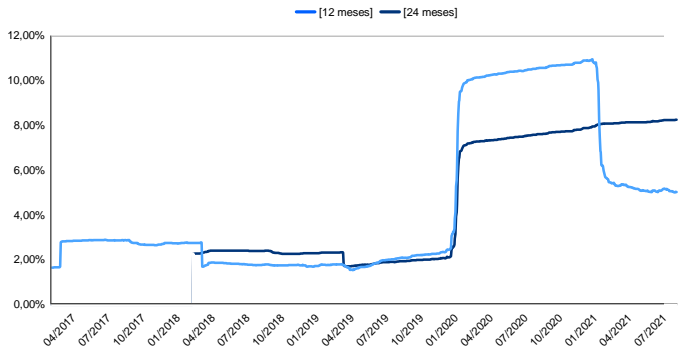
Retorno Nominal Anualizado

(Janelas Móveis)



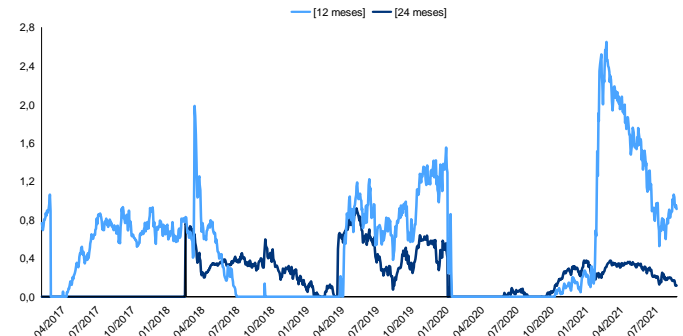
Volatilidade Anualizada

(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. O fundo utiliza estratégias com derivativos para proteção da carteira. O Fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para o Fundo e, conseqüentemente, para os seus cotistas. Administrador do fundo: SAFRA SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234 das 9 às 21H30, exceto feriados.
 SAC - Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento a deficientes auditivos ou de fala: 0800 772 4136.
 Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana. Ouvidoria - Caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236.
 Atendimento a deficientes auditivos ou de fala: 08000 727 7555. De 2ª a 6ª feira, das 09h às 18h, exceto feriados. Ou acesse: www.safra.com.br/atendimento/ouvidoria



CIZA FICFI MM CP INV EXT

Relatório Gerencial - Setembro de 2021

CIZ - 23.508.777/0001-67



Safra

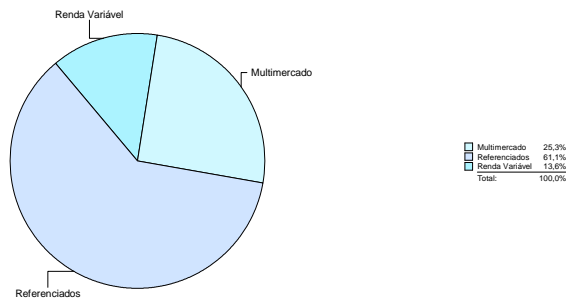
Ativos	%PL	R\$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			09/2021	2021	12 meses	24 meses			
(1) SAFRA PERFORMANCE II FI DI CRED PRIV	61,19%	1.422	0,47%	3,06%	3,90%	6,14%	0,15%	D+0	Referenciados
(2) MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	25,30%	588	1,24%	4,02%	6,92%	27,61%	3,06%	D+91	Multimercado
(3) MANAGER VELT FIC FIA	13,60%	316	-8,24%	-9,22%	4,75%	-	18,99%	D+90	Renda Variável
CAIXA	-0,09%	-2	-	-	-	-	-	D+0	-

Indicadores

CDI	0,44 %	2,51 %	2,99 %	6,65 %	0,08 %
IBOVESPA	-6,57 %	-6,75 %	17,31 %	5,95 %	20,91 %

* 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	61,10	R\$ 1.419,76
Até D+90	3	74,70	R\$ 1.735,85
Até D+91	4	100,00	R\$ 2.323,83

Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
8/jul	Resg.	SAFRA GALILEO ALOC FICFI MULTIMERCADO	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER ARGO LONG AND SHORT I FICFI MM	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MAN ABSOLUTE VERTEX S FIC FIM	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER ADAM MACRO FIC MULTIMERCADO	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER APEX INFINITY 8 LONG B FIC ACOES	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER KAPITALO ZETA FIC MULTIMERCADO	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER OCEANA LONG BIASED S FIC FI MULT	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER SPX NIMITZ IQ FIC FI MULTIMERCAD	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER TRUXT LONG BIAS FIC MULTIMERCAD	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	MANAGER BW GLOBAL RISK PREMIUM USD FIC F	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	SAFRA CREDIT OPPORTUNITIES FI RENDA FIXA	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	SAFRA DEBÊNTURES ALOCAÇÃO FI MULTIMERCA	TOTAL	Liquidado
8/jul	Resg.	SAFRA HEDGE ALOCAÇÃO FUNDO DE INVESTIME	TOTAL	Liquidado
14/jul	Resg.	MANAGER JSS SUSTAINABLE EQUITY GLOBAL TH	TOTAL	Liquidado

Matriz de Correlação - 10 Ativos Mais Alocados

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
(1)	1,00									
(2)	0,11	1,00								
(3)	-0,03	0,21	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. O fundo utiliza estratégias com derivativos para proteção da carteira. O Fundo utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para o Fundo e, conseqüentemente, para os seus cotistas. Administrador do fundo: SAFRA SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234 das 9 às 21H30, exceto feriados.

SAC - Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento a deficientes auditivos ou de fala: 0800 772 4136.

Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana. Ouvidoria - Caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236.

Atendimento a deficientes auditivos ou de fala: 08000 727 7555. De 2ª a 6ª feira, das 09h às 18h, exceto feriados. Ou acesse: www.safra.com.br/atendimento/ouvidoria

