

Samba Theta FIM

Outubro - 2020



O fundo Samba Theta posiciona-se no mercado de maneira diferenciada em um nicho ainda incipiente no mercado de bolsa nacional e se destina aos investidores em geral que pretendem preservar seu capital e manter o poder de compra ao longo do tempo.

Nossa gestão ativa busca resultados descorrelacionados com o mercado através de arbitragens (lineares e estatísticas), eventos corporativos e oportunidades de relação risco retorno assimétrico. Nossa metodologia de alocação, limita o tamanho de cada posição, minimizando o risco da carteira.

O fundo tem como objetivo acompanhar a rentabilidade do CDI, mantendo um perfil de atuação conservador, proporcionando a preservação do capital. A carteira do Fundo é composta exclusivamente por títulos públicos federais, operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais e operações de renda variável, observados os limites do regulamento.

Histórico de Rentabilidades

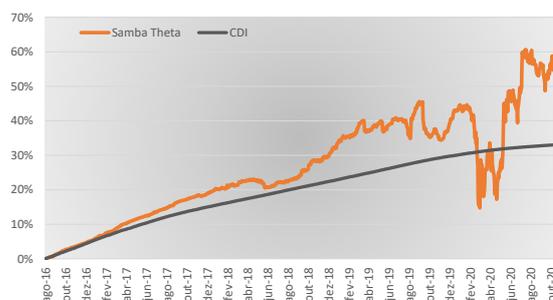
		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Desde Início
2016	Theta								0,34%	1,25%	1,10%	1,14%	1,13%	5,06%	5,06%
	% CDI								108%	113%	105%	110%	100%	107%	107%
2017	Theta	1,36%	1,06%	1,53%	1,18%	1,07%	0,79%	1,19%	0,95%	1,37%	0,85%	0,65%	0,66%	13,40%	19,14%
	% CDI	125%	122%	146%	150%	115%	97%	148%	118%	213%	131%	114%	123%	135%	126%
2018	Theta	0,95%	0,92%	0,72%	0,58%	-0,32%	-1,41%	1,01%	0,65%	0,99%	2,62%	0,91%	1,79%	9,77%	30,78%
	% CDI	163%	197%	135%	113%	-	-	187%	115%	212%	482%	184%	362%	152%	137%
2019	Theta	2,95%	0,95%	2,47%	-1,18%	1,72%	-0,56%	0,96%	0,15%	3,10%	-6,38%	-0,99%	4,44%	7,42%	40,49%
	% CDI	542%	193%	527%	-	317%	-	169%	29%	665%	-	-	1178%	124%	136%
2020	Theta	1,55%	-1,84%	-11,74%	3,01%	-0,80%	16,47%	8,03%	-0,78%	-2,25%	0,35%			10,10%	54,68%
	% CDI	413%	-	-	1055%	-	7650%	4134%	-	-	220%			413%	166%

Atribuição de Performance

	Mês Atual	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	Desde Início	2019	2018	2017	2016
Arbitragem Linear	0,00%	0,03%	0,00%	0,00%	0,08%	0,88%	1,61%	4,16%	0,24%	1,70%	1,09%	1,33%
Arbitragem Não-Linear	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,18%	0,23%	0,00%	0,19%	0,00%	0,00%
Arbitragem Estatística	-0,30%	2,84%	1,26%	6,87%	3,71%	7,00%	9,27%	13,19%	3,63%	1,97%	2,19%	0,00%
Evento Corporativo	1,62%	4,05%	5,76%	15,16%	5,26%	6,74%	10,95%	14,78%	-0,47%	5,04%	1,19%	0,38%
Direcional com Assimetria	-0,86%	5,01%	-9,05%	2,71%	6,75%	7,86%	8,44%	11,61%	2,00%	-1,48%	0,87%	0,57%
Lastro	0,01%	0,34%	-0,70%	-0,11%	0,85%	4,37%	10,09%	25,67%	4,36%	6,27%	10,68%	4,59%

Estatísticas

	Mês	Ano	3 Meses	6 Meses	12 Meses	Desde Início
Fundo	0,35%	10,10%	-2,68%	21,47%	13,85%	54,68%
CDI	0,16%	2,45%	0,48%	1,13%	3,22%	33,02%
% CDI	220%	413%	1903%	430%	166%	166%
Volatilidade	16,33%	24,84%	12,45%	22,68%	22,81%	11,67%
Índice Sharpe	-	-	-	-	0,43	0,31
PL Médio (em mil)	R\$ 18.628	R\$ 22.034	R\$ 19.447	R\$ 18.937	R\$ 24.995	R\$ 30.869
Meses Positivos	1	5	1	3	6	40
Meses Negativos	0	5	2	3	6	11
Meses Acima CDI	1	5	1	3	6	38
Meses Abaixo CDI	0	5	2	3	6	13
Max drawdown(Dias)	-	-	-	-	-	180
Max drawdown(%)	-	-	-	-	-	-21,16%



Informações Gerais

Aplicação Inicial	R\$ 5.000
Movimentação Mínima	R\$ 1.000
Saldo Mínimo	R\$ 5.000
Cotização Aplicação	D0
Cotização Resgate	D+16 (corridos)
Pagamento Resgate	D+2 úteis após cotização
Tributação	Tabela Regressiva
Taxa de Administração	2% a.a
Taxa de Performance	20% do que exceder o 100% do CDI
Categoria	Multimercado
Cod. ANBIMA	429661

Dados Aplicação

Nome:	Samba Theta FIM
CNPJ:	23.799.268/0001-30
Banco:	341 / ITAÚ
Agência:	8541
Conta:	46.199-5
Horário Limite:	14 Horas
Telefone:	(11) 3181 - 3333
E-mail:	backoffice@eshcapital.com.br

Administrador

Nome:	Intrag DTVM LTDA
CNPJ:	62.418.140/0001-31
Endereço:	Avenida: Brigadeiro Faria Lima, nº3.400 - 10º Andar Itaim Bibi - São Paulo / SP
Telefone:	0800 728 0728
Site:	www.intrag.com.br

Gestor

Nome:	ESH Capital Investimentos LTDA
CNPJ:	22.006.806/0001-20
Endereço:	Rua Cunha Gago, 700; 4ª a - cjto 41 Pinheiros - São Paulo / SP
Telefone:	(11) 3181 - 3333
Site:	www.eshcapital.com.br



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

A Samba Investimentos não comercializa nem distribui cotas de fundos de investimentos ou qualquer outro ativo financeiro. As informações divulgadas neste relatório tem caráter meramente informativo. A Samba Investimentos não se responsabiliza por erros ou omissões no conteúdo das informações divulgadas. Leia atentamente o prospecto e o regulamento antes de efetuar qualquer decisão de investimento. Visando o atendimento ao exigido pela Lei nº 9.613/98, quando do ingresso no fundo, cada cotista deverá nos fornecer cópias de seus documentos de identificação entre outros documentos cadastrais. 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. Os investimentos em fundos não são garantidos pelo administrador do fundo, gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, pelo Fundo Garantidor de Crédito - FGC. A rentabilidade obtida no passado não é garantia de rentabilidade futura. Não há garantia de que este fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo.