

# COTOVIA FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIV

Relatório Gerencial - Maio de 2022

COT - 42.066.723/0001-33



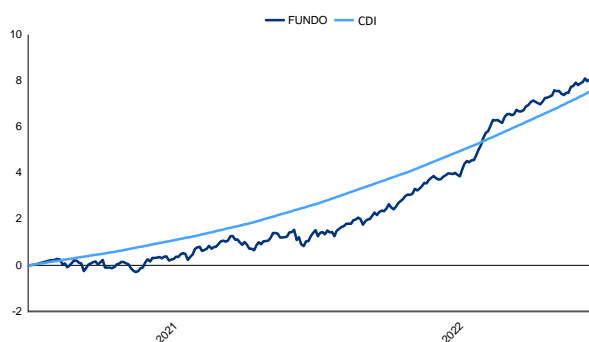
Safra

## Descrição do Fundo

### Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses(milhões)	R\$ 10,28
Categoria ANBIMA	Multimercados Investimento no Exterior
Data Início	16/06/2021
Aplicação Inicial	R\$ 0,00
Movimentação	R\$ 0,00
Saldo Mínimo	R\$ 0,00
Taxa de Administração	Alíquota: 0,30% a.a.
Taxa de Performance	Não Há
Cotas de Aplicação	D+0
Cota Conversão Resgate	D+0
Pagamento Resgate	D+1

### Rentabilidade (%) - Fundo x CDI



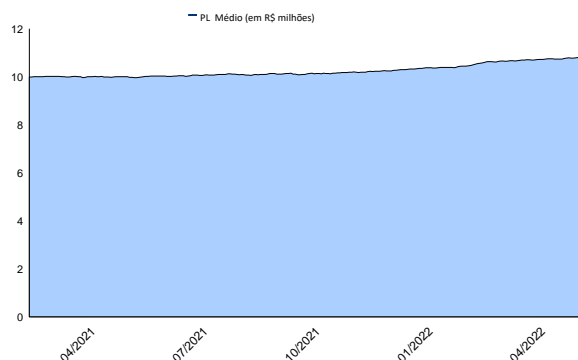
### Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	8,41 %	7,74 %	108,35 %	1,83 %
12 meses	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %
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	2,11 %	-0,32 %
12 meses		
Período em relação ao CDI	63,64 %	36,36 %
	% 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
2015	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2019	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2020	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2021	-	-	-	-	-	0,22 %	-0,32 %	0,42 %	0,40 %	-0,07 %	0,25 %	1,06 %	1,97 %
CDI	-	-	-	-	-	0,16 %	0,36 %	0,42 %	0,44 %	0,48 %	0,59 %	0,76 %	3,25 %
2022	1,01 %	0,95 %	2,11 %	1,04 %	1,05 %	-	-	-	-	-	-	-	6,31 %
CDI	0,73 %	0,75 %	0,92 %	0,83 %	1,03 %	-	-	-	-	-	-	-	4,34 %

LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Administrador do Fundo: Safra Serviços de Administração Fiduciária Ltda. Gestor do Fundo: Safra Asset Management Ltda. 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: 0800 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



# COTOVIA FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIV

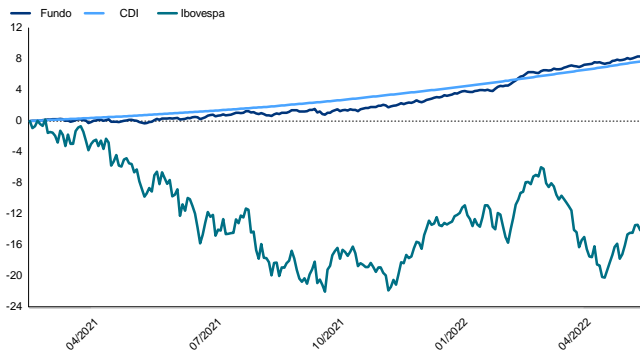
Relatório Gerencial - Maio de 2022

COT - 42.066.723/0001-33



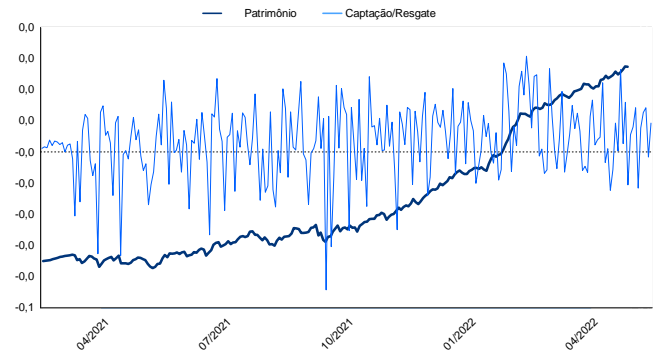
Safra

## Rentabilidade (%) - Fundo X CDI X Ibovespa



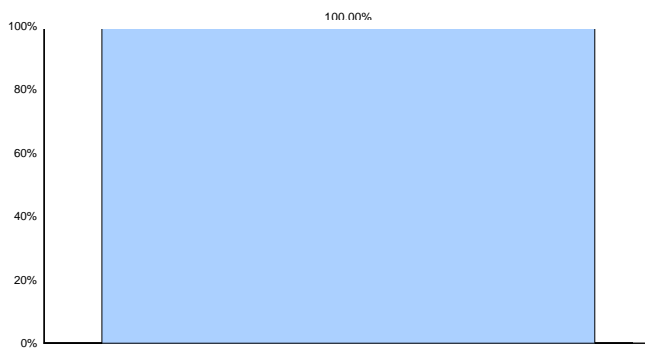
## Captação / Resgates e Patrimônio

(R\$ Milhões)



## Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Administrador do Fundo: Safra Serviços de Administração Fiduciária Ltda. Gestor do Fundo: Safra Asset Management Ltda. Administrador do fundo: SAFRA SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

E-mail: [safra.asset@safra.com.br](mailto: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](http://www.safra.com.br/atendimento/ouvidoria)



# COTOVIA FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIV

Relatório Gerencial - Maio de 2022

COT - 42.066.723/0001-33



Safra

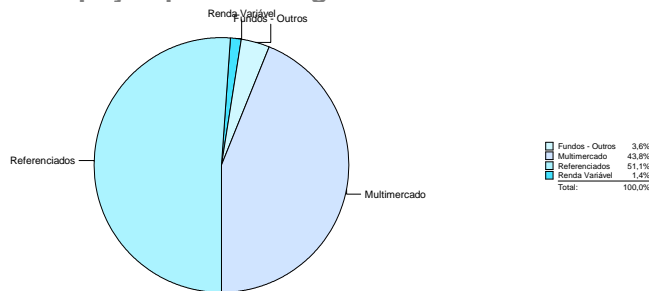
Ativos	%PL	R\$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			05/2022	2022	12 meses	24 meses			
(1) SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	43,94%	4.763	1,07%	4,40%	-	-	0,28%	D+0	Referenciados
(2) MANAGER SPX NIMITZ IQ FIC FI MULTIMERCAD	5,72%	621	1,36%	18,66%	24,13%	40,07%	6,95%	D+61	Multimercado
(3) MANAGER KAPITALO KAPPA FIC FI MULTIMERCAD	5,67%	615	1,90%	7,94%	11,72%	24,15%	4,62%	D+31	Multimercado
(4) MAN ABSOLUTE VERTEX S FIC FIM	5,42%	587	1,41%	11,79%	18,20%	25,47%	4,18%	D+30	Multimercado
(5) MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	5,13%	557	0,66%	5,59%	11,84%	17,46%	2,98%	D+91	Multimercado
(6) MAN NEO ARGO LONG AND SHORT I FICFI MM	4,90%	531	2,09%	3,16%	7,74%	13,82%	6,05%	D+32	Multimercado
(7) SAFRA CREDIT OPPORTUNITIES FI RENDA FIXA	4,81%	521	1,19%	5,03%	9,68%	16,42%	0,28%	D+16	Referenciados
(8) MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	4,46%	483	1,26%	17,70%	21,51%	33,24%	5,37%	D+31	Multimercado
(9) MANAGER VERDE FIC FI MULTIMERCADO	3,66%	397	1,26%	9,36%	3,93%	16,69%	8,25%	D+60	Multimercado
(10) MANAGER GENOA CAPITAL RADAR FIC FI MULTI	3,06%	332	1,23%	9,11%	17,42%	-	3,76%	D+31	Multimercado
MANAGER IBIUNA HEDGE STH S FIC FI MULTIM	2,98%	323	1,22%	14,00%	-	-	6,19%	D+31	-
SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	2,39%	259	0,92%	3,67%	5,04%	5,77%	1,32%	D+1	Referenciados
M L BW ALL W S BRL FIC FIM IE	2,15%	233	-2,41%	-7,15%	-	-	11,41%	D+6	Multimercado
SAFRA GALILEO ALOC FICFI MULTIMERCADO	1,54%	167	0,72%	10,35%	6,53%	12,20%	5,40%	D+32	Multimercado
MANAGER SPX FALCON FIC ACOES	1,43%	155	3,06%	7,42%	-0,30%	38,41%	15,89%	D+62	Renda Variável
MANAGER JSS SUS EQUITY GL THEMATIC	1,08%	117	-2,49%	-16,20%	-14,22%	24,31%	18,17%	D+3	Multimercado
SAFRA KAFKA PB FIC FIM CP IE	1,01%	109	-0,73%	7,35%	6,65%	12,44%	7,03%	D+16	Multimercado
MANAGER NINETY ONE GLOBAL FRANCHISE FIC	0,65%	70	0,53%	-11,95%	-	-	19,40%	D+6	-
CAIXA	0,01	1	-	-	-	-	-	D+0	-

## Indicadores

CDI	1,03 %	4,34 %	7,89 %	10,24 %	0,17 %
IBOVESPA	3,22 %	6,23 %	-11,78 %	27,40 %	19,64 %

\* 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	43,94	R\$ 4.763,98
Até D+1	3	46,33	R\$ 5.023,11
Até D+3	4	47,41	R\$ 5.140,06
Até D+6	6	50,21	R\$ 5.443,09
Até D+16	8	56,02	R\$ 6.073,57
Até D+30	9	61,44	R\$ 6.660,92
Até D+31	13	77,61	R\$ 8.413,56
Até D+32	15	84,04	R\$ 9.111,20
Até D+60	16	87,71	R\$ 9.508,37
Até D+61	17	93,43	R\$ 10.128,87
Até D+62	18	94,87	R\$ 10.284,36
Até D+91	19	100,00	R\$ 10.840,95

## Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
3/mar	Aplic.	MANAGER GENOA CAPITAL RADAR FIC FI MULTI	156.000	OK
3/mar	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	156.000	Liquidado
3/mar	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	199.216	OK
4/mar	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	60.000	OK
9/mar	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	59.063	OK
4/abr	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	2.841	Liquidado
5/abr	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	142.000	OK
3/mai	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	2.787	Liquidado
10/mai	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	7.115	Liquidado

## Matriz de Correlação - 10 Ativos Mais Alocados

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
(1)	1,00									
(2)	0,10	1,00								
(3)	0,10	0,29	1,00							
(4)	0,12	0,18	0,45	1,00						
(5)	-0,01	-0,17	-0,03	0,07	1,00					
(6)	0,02	-0,11	0,16	0,05	0,07	1,00				
(7)	0,34	0,06	0,13	0,08	0,02	0,11	1,00			
(8)	0,08	0,31	0,40	0,46	-0,01	0,02	0,10	1,00		
(9)	0,08	0,22	0,54	0,47	0,02	0,29	0,21	0,42	1,00	
(10)	0,07	0,20	-	0,07	0,04	-0,15	-0,07	0,17	-0,08	1,00

LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Administrador do Fundo: Safra Serviços de Administração Fiduciária Ltda. Gestor do Fundo: Safra Asset Management Ltda. 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: 0800 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

