

FRANCO FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Janeiro de 2022

FCO - 34.200.572/0001-36



Safra

Descrição do Fundo

Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses(milhões)	R\$ 10,95
Categoria ANBIMA	Multimercados Investimento no Exterior
Data Início	02/12/2019
Aplicação Inicial	R\$ 0,00
Movimentação	R\$ 0,00
Saldo Mínimo	R\$ 0,00
Taxa de Administração	Alíquota: 0,25% a.a.
Taxa de Performance	Não Há
Cotas de Aplicação	D+0
Cota Conversão Resgate	D+0
Pagamento Resgate	D+1

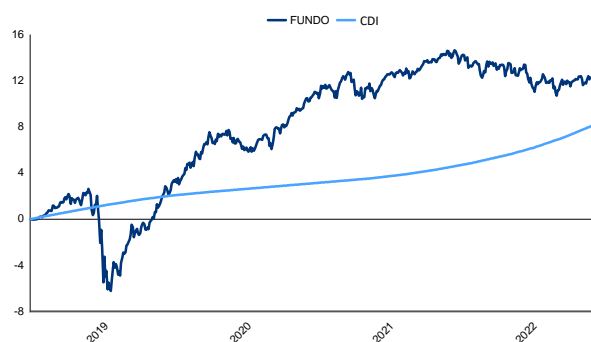
Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	13,43 %	8,49 %	154,61 %	6,01 %
12 meses	2,04 %	5,03 %	41,11 %	4,13 %
24 meses	11,55 %	7,68 %	147,71 %	6,18 %
36 meses	0,00 %	0,00 %	0,00 %	0,00 %

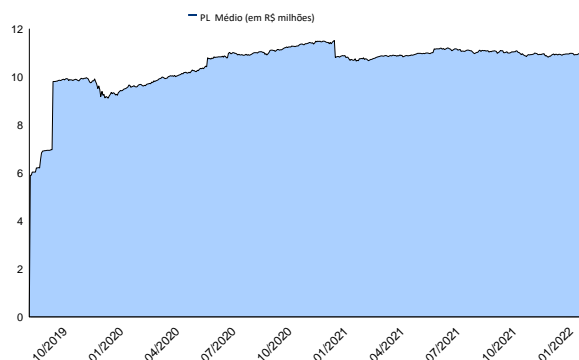
	Melhores Retornos	Piores Retornos
Mensal	3,60 %	-5,95 %
12 meses	18,63 %	0,23 %
Período em relação ao CDI	65,38 %	34,62 %

% Meses Acima do CDI % Meses Abaixo do CDI

Rentabilidade (%) - Fundo x 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,20 %	1,20 %
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,37 %	0,37 %
2020	0,48 %	-0,46 %	-5,95 %	3,60 %	2,78 %	2,29 %	2,90 %	1,00 %	-1,39 %	0,29 %	2,51 %	1,52 %	9,58 %
CDI	0,38 %	0,29 %	0,34 %	0,28 %	0,24 %	0,21 %	0,19 %	0,16 %	0,16 %	0,16 %	0,15 %	0,16 %	2,76 %
2021	0,24 %	-0,05 %	0,47 %	0,97 %	0,89 %	0,50 %	-0,88 %	0,31 %	-0,44 %	-1,41 %	-0,71 %	1,53 %	1,38 %
CDI	0,15 %	0,13 %	0,20 %	0,21 %	0,27 %	0,31 %	0,36 %	0,43 %	0,44 %	0,49 %	0,59 %	0,77 %	4,42 %
2022	0,90 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,90 %
CDI	0,73 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,73 %

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



FRANCO FIC FIM CP IE

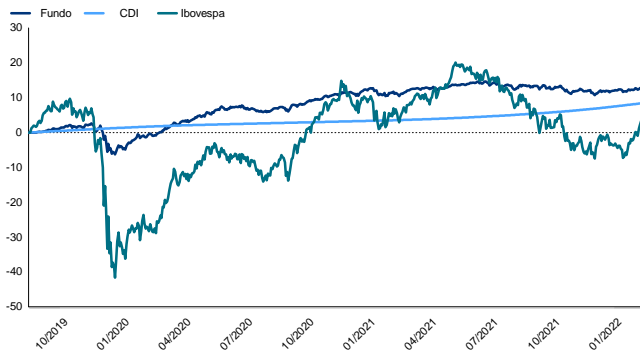
Relatório Gerencial - Janeiro de 2022

FCO - 34.200.572/0001-36



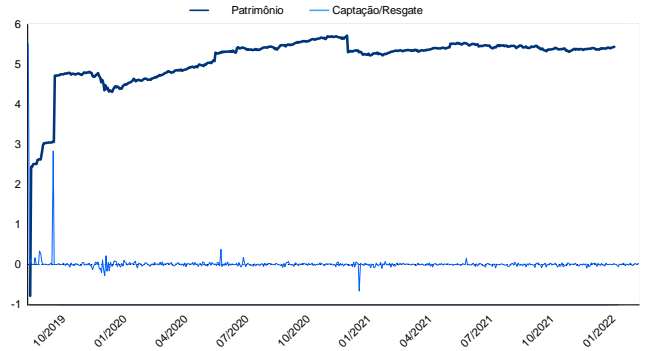
Safra

Rentabilidade (%) - Fundo X CDI X Ibovespa



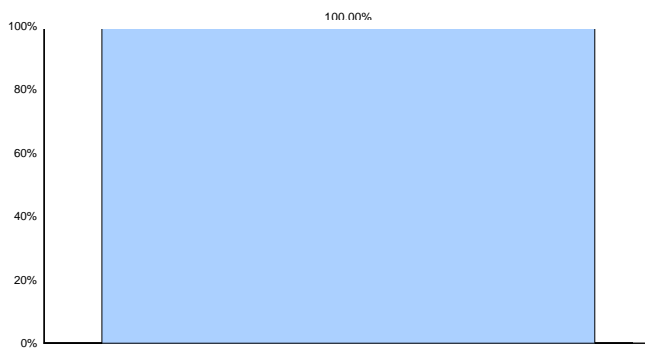
Captação / Resgates e Patrimônio

(R\$ Milhões)



Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



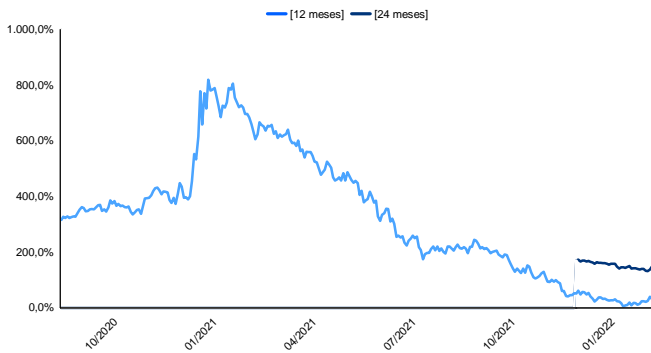
Retorno Nominal Anualizado

(Janelas Móveis)



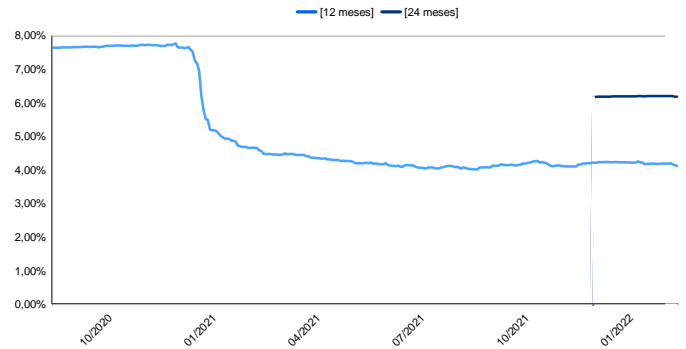
Retorno % CDI

(Janelas Móveis)



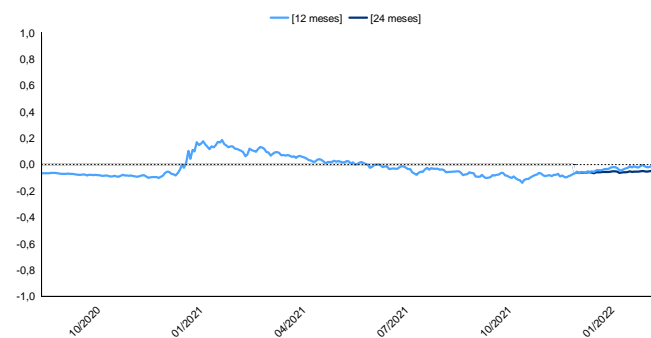
Volatilidade Anualizada

(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. 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: 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



FRANCO FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Janeiro de 2022

FCO - 34.200.572/0001-36



Safra

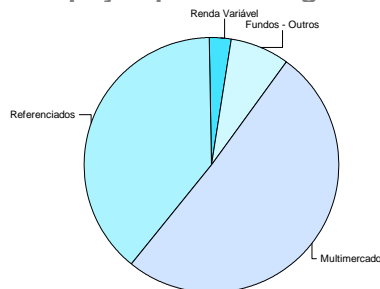
Ativos	%PL	R\$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			01/2022	2022	12 meses	24 meses			
(1) SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	31,10%	3.444	0,76%	0,76%	-	-	0,31%	D+0	Referenciados
(2) MANAGER KAPITALO KAPPA FIC MULTIMERCAD	6,49%	718	2,62%	2,62%	10,88%	12,29%	5,99%	D+31	Multimercado
(3) MANAGER SPX NIMITZ IQ FIC FI MULTIMERCAD	6,36%	704	2,28%	2,28%	14,87%	22,66%	6,64%	D+61	Multimercado
(4) MANAGER VERDE FIC FI MULTIMERCADO	5,78%	640	1,43%	1,43%	-0,82%	3,44%	7,39%	D+60	Multimercado
(5) MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	5,51%	610	1,13%	1,13%	5,12%	27,69%	3,16%	D+91	Multimercado
(6) MAN NEO ARGO LONG AND SHORT I FCIFI MM	5,47%	606	1,81%	1,81%	10,78%	15,31%	5,89%	D+31	Multimercado
(7) MAN ABSOLUTE VERTEX S FIC FIM	5,14%	569	0,49%	0,49%	9,31%	11,93%	4,85%	D+30	Multimercado
(8) MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	5,07%	562	1,37%	1,37%	5,01%	17,17%	5,32%	D+31	Multimercado
(9) SAFRA CREDIT OPPORTUNITIES FI RENDA FIXA	4,60%	510	0,81%	0,81%	7,25%	-	0,55%	D+16	Referenciados
(10) MANAGER DC FIC FI AÇÕES	4,54%	503	1,74%	1,74%	-13,84%	-	21,52%	D+14	-
M L BW ALL W S BRL FIC FIM IE	3,23%	358	-2,73%	-2,73%	-	-	10,48%	D+6	Multimercado
SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	3,18%	352	0,57%	0,57%	1,05%	6,51%	1,54%	D+1	Referenciados
SAFRA GALILEO ALOC FICFI MULTIMERCADO	2,94%	325	1,48%	1,48%	-0,52%	4,52%	4,93%	D+32	Multimercado
SAFRA KAFKA PB FIC FIM CP IE	2,20%	244	0,37%	0,37%	2,41%	-	5,28%	D+16	Multimercado
MANAGER IBIUNA HEDGE STH S FIC FI MULTIM	2,14%	237	1,24%	1,24%	-	-	5,78%	D+31	-
MANAGER JSS SUS EQUITY GL THEMATIC	1,91%	211	-5,12%	-5,12%	9,82%	-	12,34%	D+3	Multimercado
MANAGER ATMOS FIC FI ACOES	1,79%	198	0,02%	0,02%	-8,90%	0,29%	20,85%	D+62	Renda Variável
MANAGER NINETY ONE GLOBAL FRANCHISE FIC	0,96%	106	-5,24%	-5,24%	-	-	13,77%	D+6	-
MANAGER SPX FALCON FIC ACOES	0,91%	101	5,20%	5,20%	12,17%	11,18%	15,28%	D+62	Renda Variável
SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	0,71%	78	-5,18%	-5,18%	25,48%	40,50%	13,53%	D+2	Multimercado
CAIXA	-0,04%	-4	-	-	-	-	-	D+0	-

Indicadores

CDI	0,73 %	0,73 %	5,00 %	7,66 %	0,14 %
IBOVESPA	6,98 %	6,98 %	-2,54 %	-1,42 %	20,58 %

* 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	R\$ 3.440,21
Até D+1	3	R\$ 3.792,13
Até D+2	4	R\$ 3.870,44
Até D+3	5	R\$ 4.081,75
Até D+6	7	R\$ 4.545,97
Até D+14	8	R\$ 5.048,72
Até D+16	10	R\$ 5.802,52
Até D+30	11	R\$ 6.371,88
Até D+31	15	R\$ 8.494,81
Até D+32	16	R\$ 8.820,22
Até D+60	17	R\$ 9.460,08
Até D+61	18	R\$ 10.164,46
Até D+62	20	R\$ 10.463,87
Até D+91	21	R\$ 11.074,30

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: 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



FRANCO FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Janeiro de 2022

FCO - 34.200.572/0001-36



Safra

Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
5/nov	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	86.440	OK
8/nov	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	79.991	Liquidado
8/nov	Aplic.	SAFRA S P REAIS PB FI MULTIME	80.000	OK
30/nov	Resg.	MANAGER DC FIC FI AÇÕES	120.000	Liquidado
30/nov	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	525.000	OK
2/dez	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	127.413	OK
15/dez	Aplic.	MANAGER NINETY ONE GLOBAL FRANCHISE FIC	110.000	OK
15/dez	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	9.794	OK
4/jan	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	2.600	Liquidado
5/jan	Aplic.	SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	350.000	OK
5/jan	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	350.000	Liquidado
28/jan	Resg.	SAFRA GALILEO ALOC FICFI MULTIMERCADO	161.000	Carencia
28/jan	Resg.	SAFRA KAFKA PB FIC FIM CP IE	134.000	Carencia
28/jan	Resg.	MANAGER KAPITALO KAPPA FIC MULTIMERCADO	58.000	Carencia
28/jan	Resg.	MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	65.000	Carencia

Matriz de Correlação - 10 Ativos Mais Alocados

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
(1)	1,00									
(2)	0,12	1,00								
(3)	0,07	0,29	1,00							
(4)	0,04	0,61	0,23	1,00						
(5)	-0,03	0,03	-0,16	0,12	1,00					
(6)	0,02	0,11	-0,14	0,23	0,15	1,00				
(7)	0,06	0,62	0,11	0,58	0,13	0,12	1,00			
(8)	0,01	0,54	0,24	0,55	0,07	0,09	0,54	1,00		
(9)	0,14	-0,10	-0,06	0,01	0,02	-0,02	-0,17	0,04	1,00	
(10)	0,07	0,58	-0,08	0,78	0,18	0,28	0,52	0,46	0,02	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: 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

