

ES FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Dezembro de 2021

FES - 27.249.057/0001-85



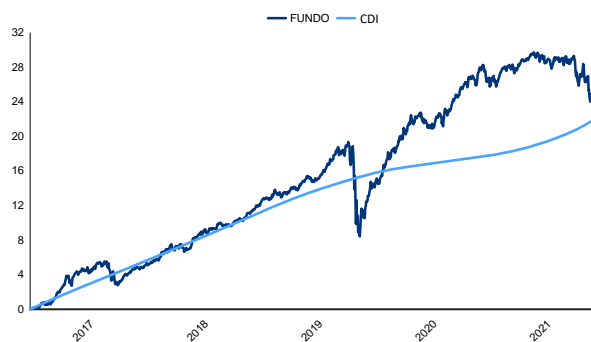
Safra

Descrição do Fundo

Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses(milhões)	R\$ 13,20
Categoria ANBIMA	Multimercados Investimento no Exterior
Data Início	20/10/2017
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	0,20% a.a.
Cotas de Aplicação	D+0
Cota Conversão Resgate	D+0
Pagamento Resgate	D+1

Rentabilidade (%) - Fundo x CDI

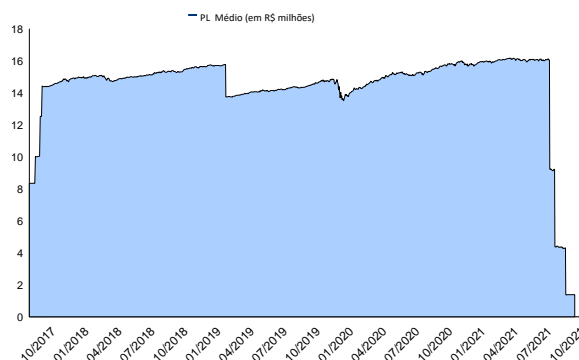


Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	25,18 %	22,59 %	110,26 %	4,68 %
12 meses	-0,89 %	4,40 %	-20,85 %	4,23 %
24 meses	7,21 %	7,28 %	99,07 %	6,27 %
36 meses	16,42 %	13,69 %	118,55 %	5,24 %

	Melhores Retornos	Piores Retornos
Mensal	2,74 %	-4,99 %
12 meses	16,29 %	-1,19 %
Período em relação ao CDI	54,00 %	46,00 %
	% 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2017	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,14 %	0,37 %	0,86 %	1,37 %
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,21 %	0,57 %	0,54 %	1,32 %
2018	2,46 %	0,33 %	0,29 %	0,84 %	-1,74 %	0,20 %	0,90 %	0,39 %	0,69 %	1,46 %	0,19 %	-0,04 %	6,06 %
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	1,54 %	0,11 %	0,41 %	0,49 %	0,80 %	0,86 %	0,60 %	0,65 %	0,55 %	0,99 %	-0,14 %	1,42 %	8,59 %
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	1,02 %	-0,81 %	-4,99 %	2,74 %	2,07 %	1,75 %	2,31 %	0,80 %	-0,93 %	0,01 %	2,42 %	1,77 %	8,18 %
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	-0,28 %	0,32 %	0,40 %	1,03 %	0,47 %	0,58 %	-0,79 %	0,41 %	-0,32 %	-2,09 %	-1,14 %	0,57 %	-0,89 %
CDI	0,15 %	0,13 %	0,20 %	0,21 %	0,27 %	0,30 %	0,36 %	0,42 %	0,44 %	0,48 %	0,59 %	0,76 %	4,40 %

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 SERV DE ADM FID LTDA, Gestor do fundo: SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.



ES FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Dezembro de 2021

FES - 27.249.057/0001-85



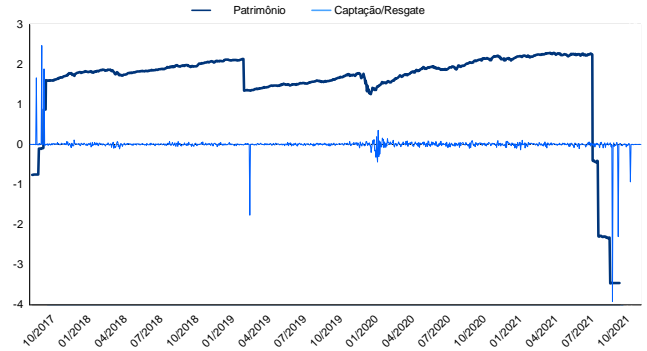
Safra

Rentabilidade (%) - Fundo X CDI X Ibovespa



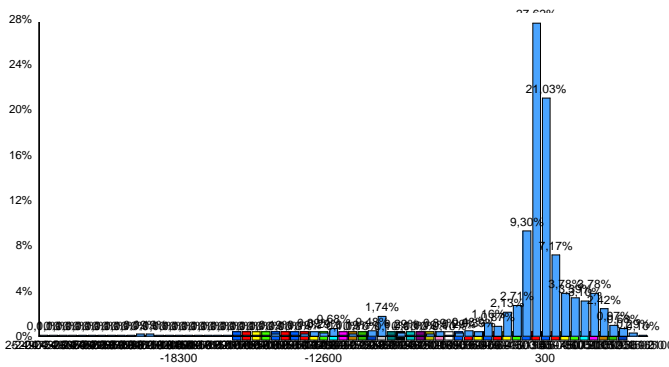
Captação / Resgates e Patrimônio

(R\$ Milhões)



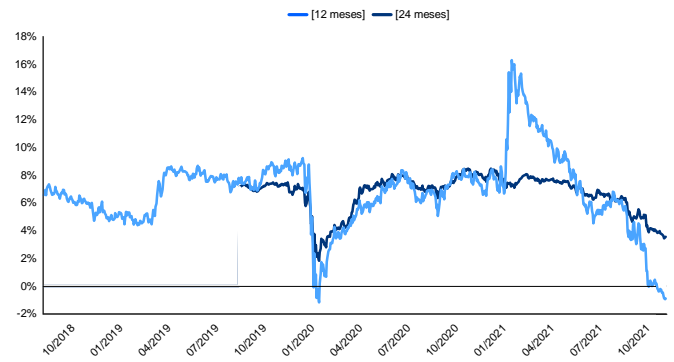
Frequência de Retornos - % CDI

(Janelas Móveis)



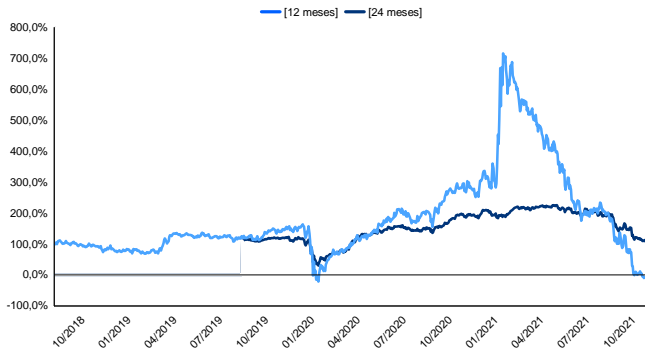
Retorno Nominal Anualizado

(Janelas Móveis)



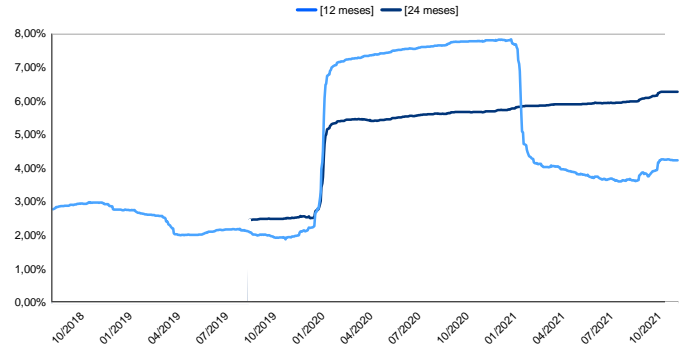
Retorno % CDI

(Janelas Móveis)



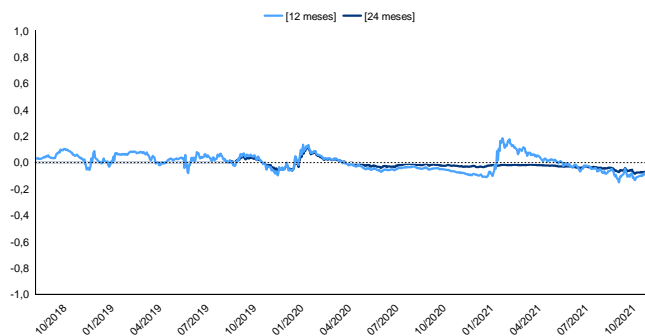
Volatilidade Anualizada

(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 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



ES FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Dezembro de 2021

FES - 27.249.057/0001-85



Safra

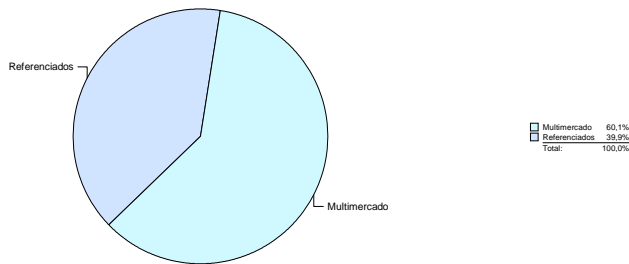
Ativos	%PL	R\$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			12/2021	2021	12 meses	24 meses			
(1) MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	60,34%	834	0,27%	5,08%	5,08%	27,28%	3,22%	D+91	Multimercado
(2) SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	39,98%	553	0,78%	-	-	-	0,33%	D+0	Referenciados
CAIXA	-0,32%	-4	-	-	-	-	-	D+0	-

Indicadores

	CDI	IBOVESPA
	0,76 %	2,85 %
	4,40 %	-11,93 %
	4,40 %	-11,93 %
	7,28 %	-9,36 %
	0,13 %	20,82 %

* 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	39,66	R\$ 548,25
Até D+91	3	100,00	R\$ 1.382,27

Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
27/out	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	118.827	Liquidado
3/nov	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	285.091	OK
4/nov	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	4.646.777	OK
4/nov	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	822.875	Liquidado
5/nov	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	735.473	OK
8/nov	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	4.689.016	Liquidado
10/nov	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	157.846	Liquidado
1/dez	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	245.595	OK
2/dez	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	1.709	Liquidado
3/dez	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	921.445	OK
6/dez	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	1.457.104	OK
6/dez	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	420.248	Liquidado
7/dez	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	720.181	OK
8/dez	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	2.835.061	Liquidado
10/dez	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	89.015	Liquidado

Matriz de Correlação - 10 Ativos Mais Alocados

	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
(1)	1,00									
(2)	-0,04	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 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

