

# KATANA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Maio de 2022

KTF - 42.338.264/0001-08



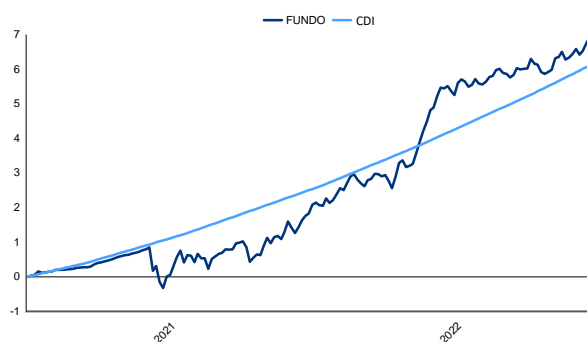
Safra

## Descrição do Fundo

### Características do Fundo

Patrimônio Líquido 12 Meses(milhões)	R\$ 9,42
Categoria ANBIMA	Multimercados Investimento no Exterior
Data Início	04/10/2021
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



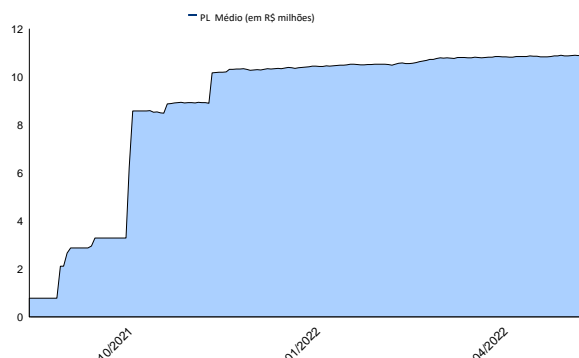
### Performance

	Fundo	CDI	% CDI	Vol.
Início	6,95 %	6,22 %	111,38 %	2,51 %
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	2,23 %	-0,45 %
12 meses		
Período em relação ao CDI	57,14 %	42,86 %
	% 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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,29 %	-0,45 %	1,14 %	0,99 %
CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,43 %	0,59 %	0,76 %	1,79 %
2022	1,08 %	0,87 %	2,23 %	0,70 %	0,90 %	-	-	-	-	-	-	-	5,90 %
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: 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



# KATANA FIC FIM CP IE

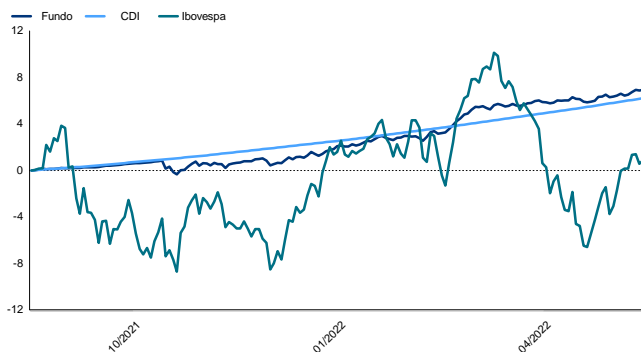
Relatório Gerencial - Maio de 2022

KTF - 42.338.264/0001-08



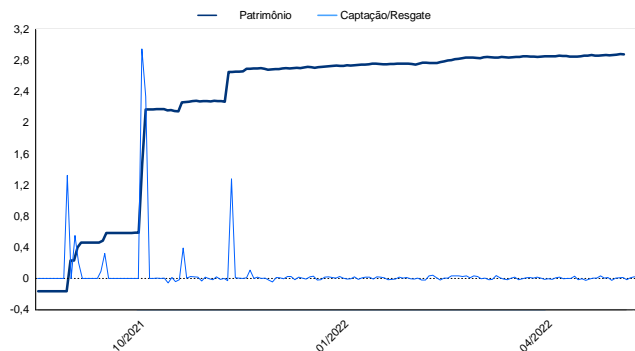
Safra

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



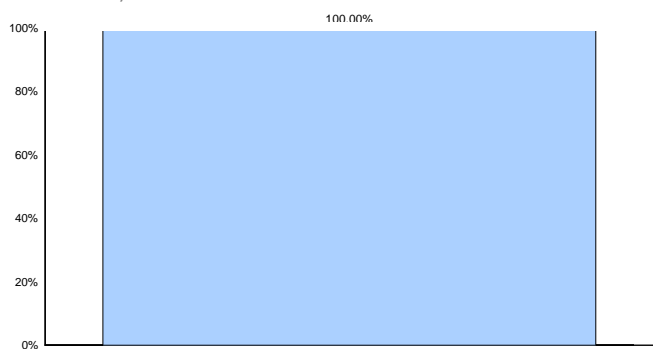
## Captação / Resgates e Patrimônio

(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. 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)



# KATANA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Maio de 2022

KTF - 42.338.264/0001-08



Safra

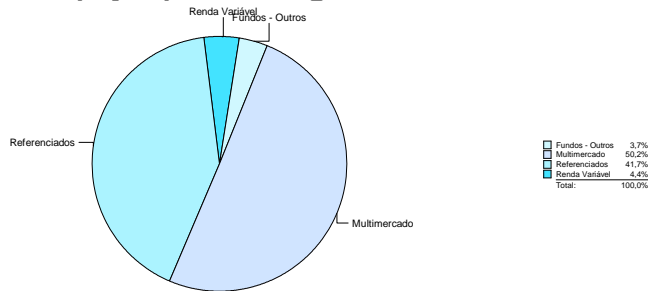
Ativos	%PL	R\$(mil)	Retornos				Volat.	Liquidez	Estratégia
			05/2022	2022	12 meses	24 meses			
(1) SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	33,25%	3.638	1,07%	4,40%	-	-	-	D+0	Referenciados
(2) MANAGER SPX NIMITZ IQ FIC FI MULTIMERCAD	6,76%	740	1,36%	18,66%	24,13%	40,07%	-	D+61	Multimercado
(3) MANAGER KAPITALO KAPPA FIC MULTIMERCAD	6,09%	666	1,90%	7,94%	11,72%	24,15%	-	D+31	Multimercado
(4) MAN ABSOLUTE VERTEX S FIC FIM	5,26%	575	1,41%	11,79%	18,20%	25,47%	-	D+30	Multimercado
(5) MANAGER LEGACY CAPITAL S FIC FIM	5,00%	547	1,26%	17,70%	21,51%	33,24%	-	D+31	Multimercado
(6) MANAGER SHARP LONG SHORT 2X FIC MULTIM	4,88%	534	0,66%	5,59%	11,84%	17,46%	-	D+91	Multimercado
(7) MAN NEO ARGO LONG AND SHORT I FCFI MM	4,84%	529	2,09%	3,16%	7,74%	13,82%	-	D+32	Multimercado
(8) SAFRA CREDIT OPPORTUNITIES FI RENDA FIXA	4,45%	487	1,19%	5,03%	9,68%	16,42%	-	D+16	Referenciados
(9) MANAGER VERDE FIC FI MULTIMERCADO	4,17%	456	1,26%	9,36%	3,93%	16,69%	-	D+60	Multimercado
(10) SAFRA PREFIXADO ALOCACAO FI RENDA FIXA	3,13%	342	0,92%	3,67%	5,04%	5,77%	-	D+1	Referenciados
MANAGER GENOA CAPITAL RADAR FIC FI MULTI	3,07%	336	1,23%	9,11%	17,42%	-	-	D+31	Multimercado
MANAGER IBIUNA HEDGE STH S FIC FI MULTIM	3,00%	328	1,22%	14,00%	-	-	-	D+31	-
M L BW ALL W S BRL FIC FIM IE	2,82%	309	-2,41%	-7,15%	-	-	-	D+6	Multimercado
MANAGER JSS SUS EQUITY GL THEMATIC	1,61%	176	-2,49%	-16,20%	-14,22%	24,31%	-	D+3	Multimercado
SAFRA GALILEO ALOC FICFI MULTIMERCADO	1,55%	169	0,72%	10,35%	6,53%	12,20%	-	D+32	Multimercado
MANAGER SQUADRA LONG BIASED FIC FI AÇÕES	1,20%	131	-2,42%	2,37%	-12,38%	-	-	D+62	Renda Variável
MANAGER ATMOS FIC FI ACOES	1,12%	123	-1,50%	-12,56%	-29,18%	12,70%	-	D+62	Renda Variável
MANAGER VELT FIC FIA	1,02%	112	-3,19%	-12,94%	-37,48%	-15,03%	-	D+90	Renda Variável
SAFRA KAFKA PB FIC FIM CP IE	1,02%	111	-0,73%	7,35%	6,65%	12,44%	-	D+16	Multimercado
MANAGER SPX FALCON FIC ACOES	1,01%	111	3,06%	7,42%	-0,30%	38,41%	-	D+62	Renda Variável
MANAGER OCEANA LONG BIASED S FIC FI MULT	0,97%	106	1,04%	3,33%	-6,90%	15,72%	-	D+32	Multimercado
MAN TRUXT LONG BIAS S FIC FIM	0,97%	106	-1,70%	7,02%	-19,96%	12,12%	-	D+32	Multimercado
SAF COMMITTED CASH FICFI REF DI CP	0,91%	99	1,06%	4,39%	-	-	-	D+0	Referenciados
MANAGER NINETY ONE GLOBAL FRANCHISE FIC	0,70%	76	0,53%	-11,95%	-	-	-	D+6	-
MAN TGR GLOBAL FIM CP IE	0,68%	75	-3,72%	-	-	-	-	D+1	Multimercado
MAN VTL FIM	0,48%	52	-	-	-	-	-	D+1	Multimercado
KINEA PRIV EQUITY V FIP	0,04%	4	-0,23%	-13,57%	-	-	-	D+1	-
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	3	34,17	R\$ 3.738,65
Até D+1	7	38,50	R\$ 4.212,26
Até D+3	8	40,11	R\$ 4.388,11
Até D+6	10	43,62	R\$ 4.772,91
Até D+16	12	49,10	R\$ 5.371,53
Até D+30	13	54,35	R\$ 5.946,80
Até D+31	17	71,51	R\$ 7.823,94
Até D+32	21	79,83	R\$ 8.734,41
Até D+60	22	84,00	R\$ 9.190,75
Até D+61	23	90,77	R\$ 9.930,82
Até D+62	26	94,10	R\$ 10.295,23
Até D+90	27	95,12	R\$ 10.407,11
Até D+91	28	100,00	R\$ 10.940,94

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



# KATANA FIC FIM CP IE

Relatório Gerencial - Maio de 2022

KTF - 42.338.264/0001-08



Safra

## Últimas Movimentações

Data	Aplic./Resg.	Contraparte	Valor	Status
4/mar	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	37.000	OK
7/mar	Aplic.	MAN TGR GLOBAL FIM CP IE	80.000	OK
7/mar	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	80.000	Liquidado
9/mar	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	37.000	OK
4/abr	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	35.123	OK
5/abr	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	98.000	OK
6/abr	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	37.000	OK
12/abr	Aplic.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	37.000	OK
19/abr	Resg.	MANAGER VELT FIC FIA	TOTAL	Carencia
3/mai	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	2.734	Liquidado
4/mai	Aplic.	MAN VTL FIM	50.000	OK
4/mai	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	50.000	Liquidado
10/mai	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	7.115	Liquidado
18/mai	Aplic.	MANAGER ATMOS FIC FI ACOES	120.000	OK
18/mai	Resg.	SAFRA CASH FIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI	120.000	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)	0,08	0,31	0,40	0,46	1,00					
(6)	-0,01	-0,17	-0,03	0,07	-0,01	1,00				
(7)	0,02	-0,11	0,16	0,05	0,02	0,07	1,00			
(8)	0,34	0,06	0,13	0,08	0,10	0,02	0,11	1,00		
(9)	0,08	0,22	0,54	0,47	0,42	0,02	0,29	0,21	1,00	
(10)	0,07	-0,03	0,02	-0,09	0,11	-0,07	0,19	0,37	0,33	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

