



SAFRA INSTITUCIONAL DI FIC REFERENCIADO

SCO

Janeiro de 2012

Características

Categoria ANBIMA	Referenciado DI	Aplicação inicial	R\$ 2.000.000,00
Data início	23/03/1998	Movimentação	R\$ 5.000,00
Taxa de administração	Máxima: 0,30% a.a.	Saldo Mínimo	R\$ 50.000,00
Cotas de Aplicação	D+0	Horário	09:01 às 16:00
Cota conversão resgate	D+0	Patrimônio Liq. em 12 meses (R\$ MM)	R\$ 221,59
Pagamento resgate	D+0	Tributação	Longo Prazo conforme Tabela Regressiva.

Descrição do Fundo

Aplica em cotas de fundos de investimento com carteira composta por títulos públicos federais e valores mobiliários com o objetivo de buscar acompanhar as oscilações da taxa de juros.

Destinado a investidores de perfil conservador que buscam acompanhar a evolução do CDI no médio/longo prazo.

Rentabilidade Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2005	1,37%	1,21%	1,52%	1,40%	1,49%	1,59%	1,51%	1,64%	1,53%	1,41%	1,42%	1,49%	19,05%
CDI	1,38%	1,21%	1,52%	1,41%	1,50%	1,58%	1,51%	1,65%	1,50%	1,41%	1,38%	1,47%	19,00%
2006	1,45%	1,15%	1,41%	1,07%	1,26%	1,17%	1,16%	1,23%	1,04%	1,08%	1,00%	0,97%	14,92%
CDI	1,43%	1,14%	1,42%	1,08%	1,28%	1,18%	1,17%	1,25%	1,05%	1,09%	1,02%	0,98%	15,05%
2007	1,06%	0,85%	1,03%	0,92%	1,01%	0,89%	0,95%	0,97%	0,79%	0,91%	0,82%	0,83%	11,62%
CDI	1,08%	0,87%	1,05%	0,94%	1,02%	0,90%	0,97%	0,99%	0,80%	0,92%	0,84%	0,84%	11,82%
2008	0,92%	0,78%	0,83%	0,79%	0,86%	0,93%	1,06%	1,00%	1,07%	1,10%	0,95%	0,91%	11,78%
CDI	0,92%	0,80%	0,84%	0,90%	0,87%	0,95%	1,06%	1,01%	1,10%	1,17%	1,00%	1,11%	12,37%
2009	1,04%	0,90%	1,01%	0,89%	0,81%	0,86%	0,88%	0,74%	0,75%	0,75%	0,70%	0,75%	10,55%
CDI	1,05%	0,85%	0,97%	0,84%	0,77%	0,76%	0,79%	0,69%	0,69%	0,69%	0,66%	0,72%	9,90%
2010	0,67%	0,60%	0,76%	0,67%	0,75%	0,80%	0,86%	0,91%	0,86%	0,82%	0,81%	0,93%	9,87%
CDI	0,66%	0,59%	0,76%	0,66%	0,75%	0,79%	0,86%	0,89%	0,84%	0,81%	0,81%	0,93%	9,74%
2011	0,86%	0,85%	0,93%	0,85%	1,00%	0,97%	0,97%	1,06%	0,94%	0,88%	0,86%	0,91%	11,66%
CDI	0,86%	0,84%	0,92%	0,84%	0,99%	0,95%	0,97%	1,07%	0,94%	0,88%	0,86%	0,91%	11,59%
2012	0,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,89%
CDI	0,89%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,89%

Estatísticas

	Rent. Fundo	CDI	% CDI	Volatilidade
12 meses	11,69%	11,63%	100,55%	0,03%
24 meses	22,95%	22,75%	100,82%	0,06%
36 meses	35,42%	34,37%	102,63%	0,07%
Início	726,06%	728,27%	99,87%	0,33%

% Meses Acima do CDI	43%
% Meses Abaixo do CDI	57%
% Meses Positivos CDI	100%
% Meses Negativos CDI	-%

Máximo drawdown	
Perda Máxima(dias)	
Recuperação(dias)	1

	Melhores retornos	Piores retornos
Mensal	2,10%	Mensal 0,60%
12 meses	46,82%	12 meses 9,16%

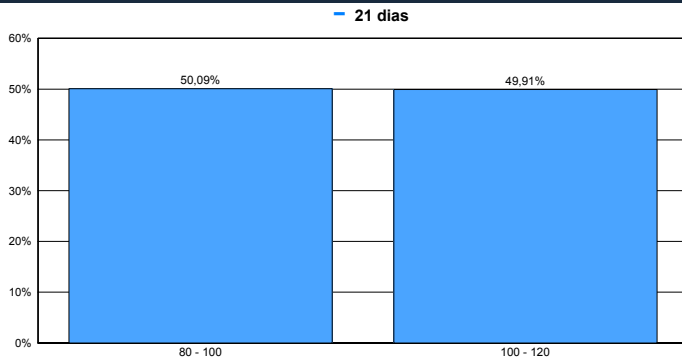


SAFRA INSTITUCIONAL DI FIC REFERENCIADO

SCO

Janeiro de 2012

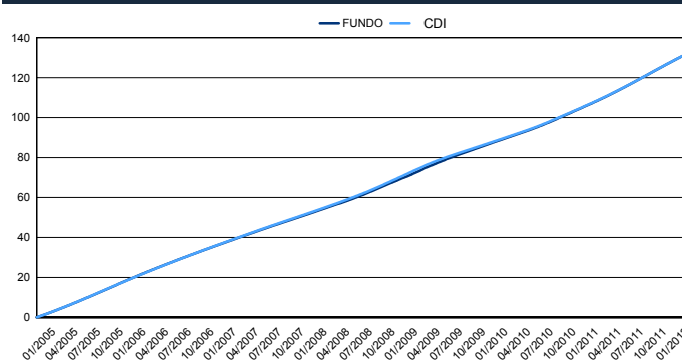
Frequência de Retornos - % CDI (Janelas Móveis)



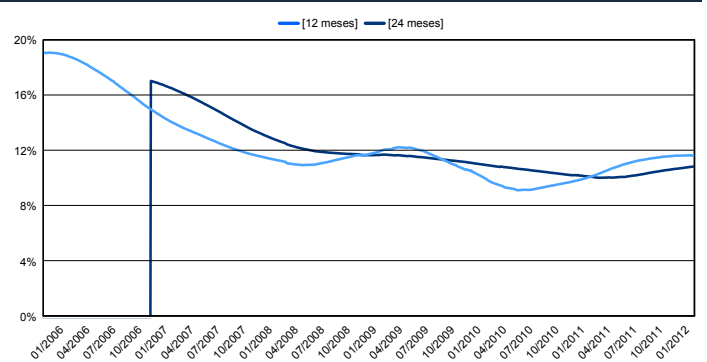
Patrimônio Líquido (R\$ Milhões)



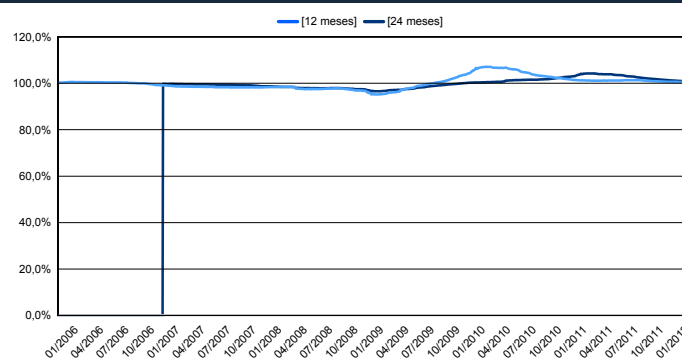
Evolução de Rentabilidade (%) - Desde o Início



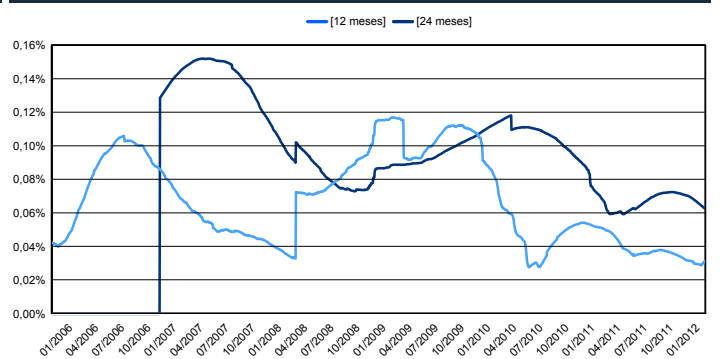
Retorno Nominal Anualizado - Janelas Móveis



Retorno % CDI - Janelas Móveis



Volatilidade Anualizada - Janelas Móveis



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. É recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento pelo investidor ao aplicar seus recursos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. LEIA O PROSPECTO E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. A rentabilidade não é líquida de impostos. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo. Administrador do Fundo: JS Administração de Recursos SA / Gestor do Fundo: Banco J Safra SA. SAFRA INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO REFERENCIADO. Taxa de administração mínima 0,25% ao ano. Taxa de administração máxima 0,50% ao ano. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para fundos de longo prazo.

E-mail: safra.asset@safra.com.br. Central de Atendimento Safra: 0300 105 1234, de 2ª a 6ª-feira, das 9 às 19h, exceto feriados. Atendimento aos portadores de necessidades especiais, auditivas e fala. SAC ☐ Serviço de Atendimento ao Consumidor: 0800 772 5755. Atendimento 24 horas por dia, 7 dias por semana. Ouvidoria ☐ caso já tenha recorrido ao SAC e não esteja satisfeito(a): 0800 770 1236, de 2ª a 6ª-feira, das 9h às 18h, exceto feriados.