



Relatório de Fundo Exclusivo

FIF UNIPREV III

30 de abril de 2024



FIF UNIPREV III

RESUMO DO FUNDO

DATA DE REFERÊNCIA

30/04/2024

PATRIMÔNIO ATUAL (R\$)

135.700.048,28

COTA ATUAL (R\$)

10,0204611

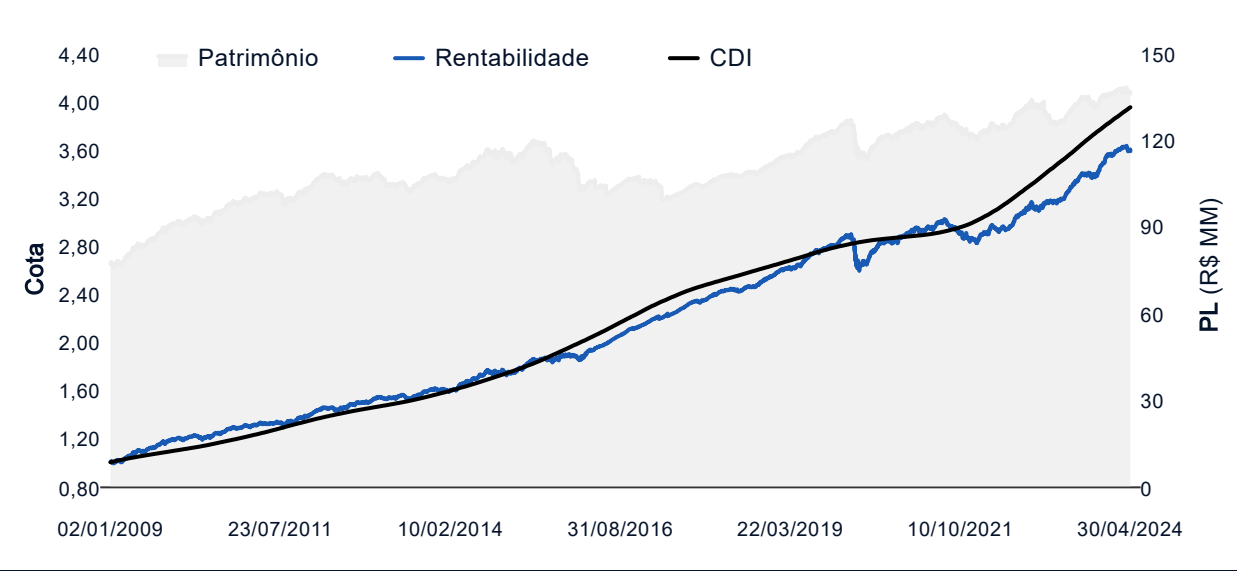
INDICADORES

	Mês	Ano	12M	2023	Início
Rentabilidade (%)	-1,04	0,66	12,31	13,59	902,05
% CDI	-116,91	18,67	99,83	104,16	106,24
Retorno Real (IPCA + %)	-1,30	-1,21	8,16	8,56	268,60
CDI (%)	0,89	3,54	12,33	13,05	849,10
IPCA (%)	0,27	1,89	3,83	4,64	171,85
IMA-B (%)	-1,61	-1,44	7,83	16,05	1.250,39
IHFA (%)	-1,49	-0,71	6,67	9,28	365,70
IBOV (%)	-1,70	-6,16	20,58	22,28	1.097,68
DOL (%)	3,51	6,83	3,42	-7,21	44,46

ESTATÍSTICA HISTÓRICA

Meses Negativos	38
Meses Positivos	146
Retorno Mensal Máximo	3,28%
Retorno Mensal Mínimo	-7,36%
Meses Acima do CDI	97
Meses Abaixo do CDI	87
Volatilidade 12 Meses	2,94%
Volatilidade Início	4,18%
Sharpe 3 Meses	-3,48

EVOLUÇÃO DA PERFORMANCE E DO PATRIMÔNIO



Resumo da Performance

Data base: 30/04/2024

RETORNOS MENSAIS

Data de Início: 07/02/2003

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Desde Início
2009	0,23	0,53	2,19	3,28	2,94	-0,12	1,68	0,82	2,58	0,50	2,32	0,94	19,34	234,11
CDI	1,00	0,85	0,97	0,84	0,77	0,76	0,79	0,69	0,69	0,69	0,66	0,72	9,84	164,35
2010	-0,32	0,71	1,63	-0,30	-0,65	-0,37	3,20	-0,04	2,17	1,09	-0,18	1,42	8,59	262,82
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	190,10
2011	-0,08	1,08	1,20	-0,22	0,34	0,39	-0,20	0,39	-0,08	2,46	0,63	0,96	7,06	288,41
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	223,74
2012	2,25	1,54	0,53	0,37	-1,15	0,75	1,27	0,52	1,01	0,43	0,77	1,49	10,19	328,00
CDI	0,89	0,74	0,81	0,70	0,73	0,64	0,68	0,69	0,54	0,61	0,54	0,53	8,41	250,98
2013	0,39	-0,46	0,63	0,67	0,25	-1,42	0,97	0,81	1,53	1,66	0,09	0,03	5,25	350,49
CDI	0,59	0,48	0,54	0,60	0,58	0,59	0,71	0,69	0,70	0,80	0,71	0,78	8,05	279,24
2014	-1,09	0,71	1,99	1,24	0,58	1,51	1,57	2,62	-1,72	1,07	0,79	-0,88	8,62	389,34
CDI	0,84	0,78	0,76	0,81	0,86	0,82	0,94	0,86	0,90	0,94	0,84	0,95	10,81	320,23
2015	-0,44	2,46	0,80	2,44	-0,31	1,11	0,37	-0,77	0,31	1,15	0,03	0,34	7,70	427,02
CDI	0,93	0,82	1,03	0,95	0,98	1,06	1,18	1,11	1,11	1,11	1,06	1,16	13,23	375,82
2016	-0,22	1,34	1,31	1,44	0,68	1,40	1,48	1,27	1,24	1,52	0,42	0,93	13,57	498,56
CDI	1,05	1,00	1,16	1,05	1,11	1,16	1,11	1,21	1,11	1,05	1,04	1,12	14,00	442,44
2017	1,13	1,05	0,11	0,96	0,62	0,97	1,28	1,20	1,14	0,21	0,31	1,20	10,66	562,35
CDI	1,09	0,87	1,05	0,79	0,93	0,81	0,80	0,80	0,64	0,65	0,57	0,54	9,95	496,42
2018	1,26	0,54	0,77	0,51	-0,66	0,20	1,02	0,08	0,74	1,81	0,86	0,91	8,32	617,43
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	534,73
2019	1,39	0,24	0,26	1,04	1,08	1,26	1,33	0,78	0,66	0,70	0,15	1,67	11,07	696,85
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	572,61
2020	0,72	-1,24	-7,36	1,07	1,82	2,19	2,29	0,28	-0,36	-0,14	1,92	1,33	2,14	713,92
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	591,23
2021	0,13	-0,24	0,71	0,50	1,03	0,66	-0,65	-0,92	-1,29	-1,83	-0,60	0,52	-2,01	697,53
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	621,61
2022	1,46	0,35	1,92	-1,04	0,88	-0,62	2,02	1,85	0,95	2,29	-0,90	0,37	9,89	776,37
CDI	0,73	0,75	0,92	0,83	1,03	1,01	1,03	1,17	1,07	1,02	1,02	1,12	12,37	710,89
2023	1,07	-0,23	0,40	0,56	1,99	2,33	1,49	0,07	0,18	-0,18	2,97	2,23	13,59	895,47
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	1,07	1,14	0,97	1,00	0,92	0,90	13,05	816,69
2024	0,03	1,06	0,62	-1,04									0,66	902,05
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89									3,54	849,10

Líquida de taxa de administração e performance, porém não líquida de impostos devidos. Início das atividades em 07/02/2003. Patrimônio médio em 12 meses: **R\$ 133,63 MM.**

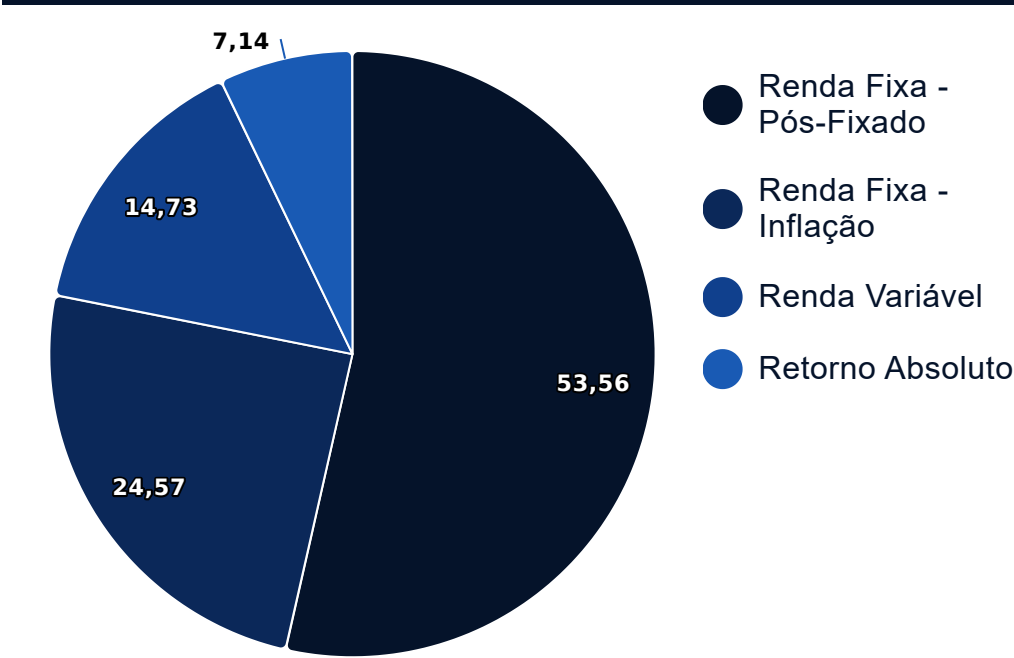
Composição e liquidez da carteira

Data base: 30/04/2024

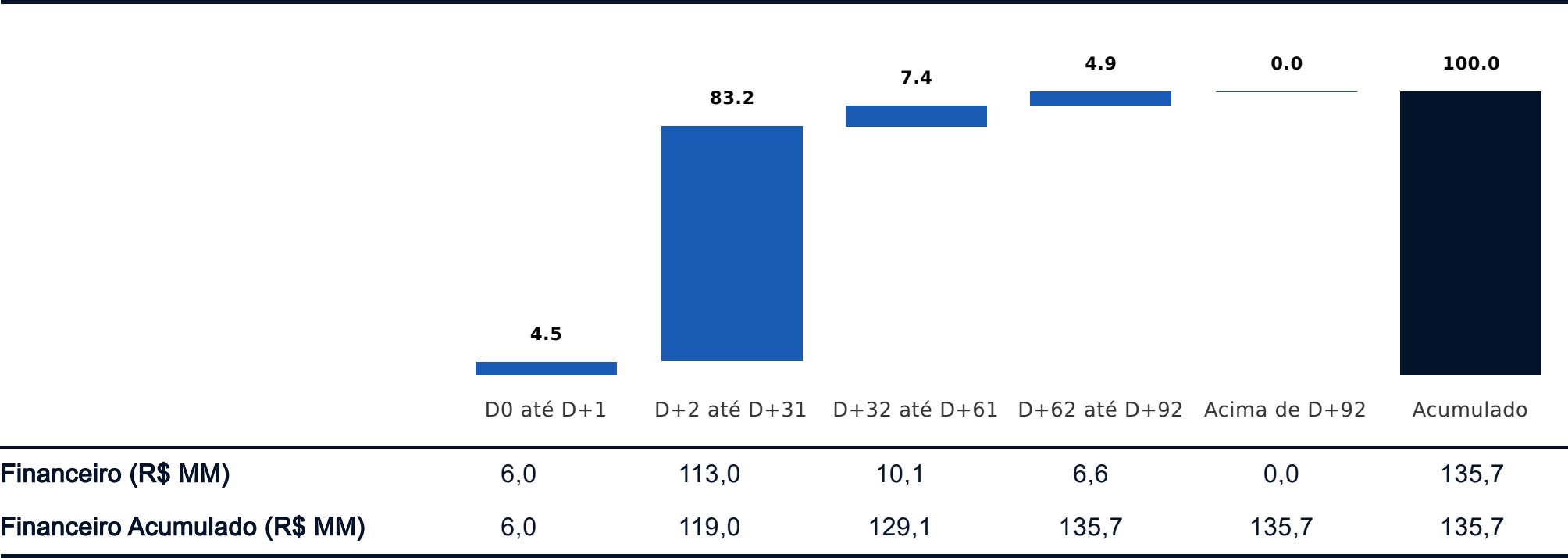
PARTICIPAÇÃO POR CLASSE (% DO PL)

	Abr-23	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24
Renda Fixa - Pós-Fixado	39,98	39,75	48,90	47,43	48,30	50,44	50,64	49,73	51,78	59,56	59,60	59,74	53,56
Renda Fixa - Inflação	50,59	50,30	39,86	39,60	39,41	37,22	37,38	33,56	25,27	25,04	24,92	24,79	24,57
Retorno Absoluto	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,85	7,04	0,00	0,00	0,00	7,14
Renda Variável	9,43	9,94	11,23	12,97	12,28	12,34	11,97	13,01	15,90	15,40	15,47	15,47	14,73
Outros	0,00	0,01	0,01	0,00	0,01	0,00	0,01	1,85	0,02	0,01	0,00	0,00	0,00

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE (%)



LIQUIDEZ DA CARTEIRA (%)



Composição e retorno da carteira

Data base: 30/04/2024

ATIVOS

	Emissor	Financeiro (R\$)	% do PL
Renda Fixa - Pós-Fixado		72,677,092.77	53,56%
BTG PAC CORP I FIQRF	BTG PACTUAL AM	66,636,646.58	49,11%
COMPROMISSADA 02/05/2024	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ	6,040,446.19	4,45%
Renda Fixa - Inflação		33,348,025.20	24,57%
TESOURO IPCA GERALRF	BTG PACTUAL AM	19,956,619.40	14,71%
TESOURO IPCA LONGORF	BTG PACTUAL AM	13,391,405.80	9,87%
Retorno Absoluto		9,685,587.64	7,14%
BTG EXPLORER IN FIRF	BTG PACTUAL AM	9,685,587.64	7,14%
Renda Variável		19,989,136.04	14,73%
SQUADRA INST FIA	SQUADRA INVESTIMENTOS -.	3,512,576.73	2,59%
ABSOLUTO INS FIQ FIA	BTG PACTUAL AM	3,372,346.55	2,49%
OCEANA SELECTION P FUNDO DE INVESTIMENT...	OCEANA INV ADM CARTEIRA VALORES MOBILIARIOS	3,359,294.13	2,48%
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIA	SHARP CAPITAL GEST	3,333,269.10	2,46%
PS EQ INFLATION FIA	BTG PACTUAL WM.	3,281,716.32	2,42%
AP INST II FIC FIA	ABSOLUTO PARTNERS	3,129,933.22	2,31%
Outros		191.82	-%
FIF UNIPREV III		135,700,033.47	100,00%

ESTATÍSTICAS DOS ATIVOS (%)

Mês	Ano	12M	2023	Desde o 1º Aporte	Vol.3M	Data 1º Aporte
0,98	4,82	17,22	13,15	81,63	0,35	17/02/2017
-	-	-	-	-	-	-
-1,65	-1,55	7,48	15,73	14,41	2,65	23/09/2022
-2,94	-4,46	6,56	18,93	1,11	4,29	09/06/2023
-0,87	1,41	9,65	13,17	2,53	1,94	30/11/2023
-6,38	-6,37	28,21	36,95	11,46	9,46	09/06/2023
-7,28	-8,03	17,38	15,82	54,21	12,10	23/09/2016
-7,08	-8,13	22,10	28,75	6,36	14,12	09/06/2023
-5,88	-5,77	15,77	15,04	6,33	10,43	07/06/2023
-4,01	-7,32	13,26	-	-3,30	10,87	12/12/2023
-5,65	-9,09	13,52	22,95	-1,91	13,66	09/06/2023
-1,04	0,66	12,31	13,59	902,05	4.18	-

Extrato de movimentações

Data base: 30/04/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	BTG PAC CORP I FIQRF	-	18/04/2024	19/04/2024	-	3.000.000,00	3,28
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	01/04/2024	236,00	3.413.052,14	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	02/04/2024	236,00	3.414.473,85	10,64
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	03/04/2024	4.074,00	3.416.081,77	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	04/04/2024	234,00	3.409.244,26	10,64
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	05/04/2024	4.077,00	3.418.896,86	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	08/04/2024	234,00	3.411.967,69	10,64
Venda	NTNB IPCA	15/05/2045	-	09/04/2024	812,00	3.414.685,77	10,64
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	10/04/2024	4.075,00	3.416.504,62	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	11/04/2024	234,00	3.416.057,52	10,64
Venda	LTN OVER	01/01/2030	-	12/04/2024	6.489,00	3.419.119,56	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	15/04/2024	234,00	3.418.787,20	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2026	-	16/04/2024	233,00	3.417.924,28	10,64
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	17/04/2024	233,00	3.411.963,17	10,64
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	18/04/2024	231,00	3.384.030,46	10,64
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	19/04/2024	233,00	3.414.754,58	10,64
Venda	LTN OVER	01/07/2026	-	22/04/2024	7.906,00	6.227.841,11	10,64
Venda	NTNF PRE	01/01/2029	-	23/04/2024	6.431,00	6.229.721,05	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	24/04/2024	425,00	6.227.597,98	10,64
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	25/04/2024	427,00	6.232.649,66	10,64
Venda	LTN OVER	01/04/2025	-	26/04/2024	6.872,00	6.237.209,12	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2028	-	29/04/2024	426,00	6.234.175,90	10,64

Extrato de movimentações

Data base: 30/04/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Venda	LFT REF	01/09/2028	-	30/04/2024	426,00	6.236.732,01	10,64

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	02/05/2024	412,00	6.042.870,32	10,64
Venda	LTN OVER	01/04/2026	-	03/05/2024	7.434,00	6.047.220,28	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	06/05/2024	414,00	6.047.305,98	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	07/05/2024	414,00	6.049.727,88	10,64

SAC

0800 772 28 27

Ouvidoria

0800 722 00 48

btgpactual.com

