



Relatório de Fundo Exclusivo

FIF UNIPREV III

29 de dezembro de 2023



FIF UNIPREV III

RESUMO DO FUNDO

DATA DE REFERÊNCIA

29/12/2023

PATRIMÔNIO ATUAL (R\$)

135.701.100,56

COTA ATUAL (R\$)

9,9547452

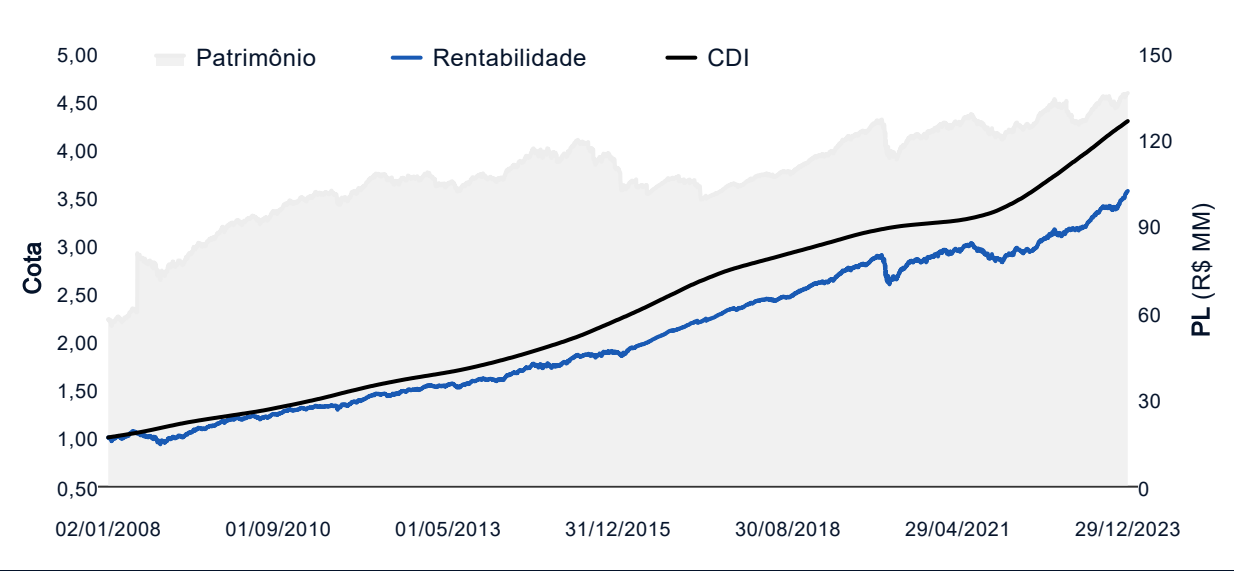
INDICADORES

	Mês	Ano	12M	2022	Início
Rentabilidade (%)	2,23	13,59	13,68	9,89	895,47
% CDI	248,87	104,16	103,94	79,89	109,65
Retorno Real (IPCA + %)	1,81	8,56	8,58	3,84	273,12
CDI (%)	0,90	13,05	13,16	12,37	816,69
IPCA (%)	0,41	4,64	4,70	5,83	166,80
IMA-B (%)	2,75	16,05	16,18	6,37	1.270,14
IHFA (%)	2,53	9,28	9,31	13,54	369,03
IBOV (%)	5,38	22,28	21,72	4,69	1.176,25
DOL (%)	-1,91	-7,21	-8,20	-6,50	35,22

ESTATÍSTICA HISTÓRICA

Meses Negativos	44
Meses Positivos	148
Retorno Mensal Máximo	3,83%
Retorno Mensal Mínimo	-7,36%
Meses Acima do CDI	101
Meses Abaixo do CDI	91
Volatilidade 12 Meses	3,10%
Volatilidade Início	4,69%
Sharpe 3 Meses	3,13

EVOLUÇÃO DA PERFORMANCE E DO PATRIMÔNIO



Resumo da Performance

Data base: 29/12/2023

RETORNOS MENSAIS

Data de Início: 07/02/2003

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Desde Início
2008	-1,78	3,00	-1,77	3,05	3,83	-1,98	-1,88	-0,82	-1,52	-4,05	0,58	2,45	-1,23	176,50
CDI	0,88	0,80	0,84	0,90	0,87	0,95	1,06	1,01	1,10	1,17	1,00	1,11	12,32	140,54
2009	1,48	0,53	2,19	3,28	2,94	-0,12	1,68	0,82	2,58	0,50	2,32	0,94	20,84	234,11
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	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

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\$ 130,61 MM.**

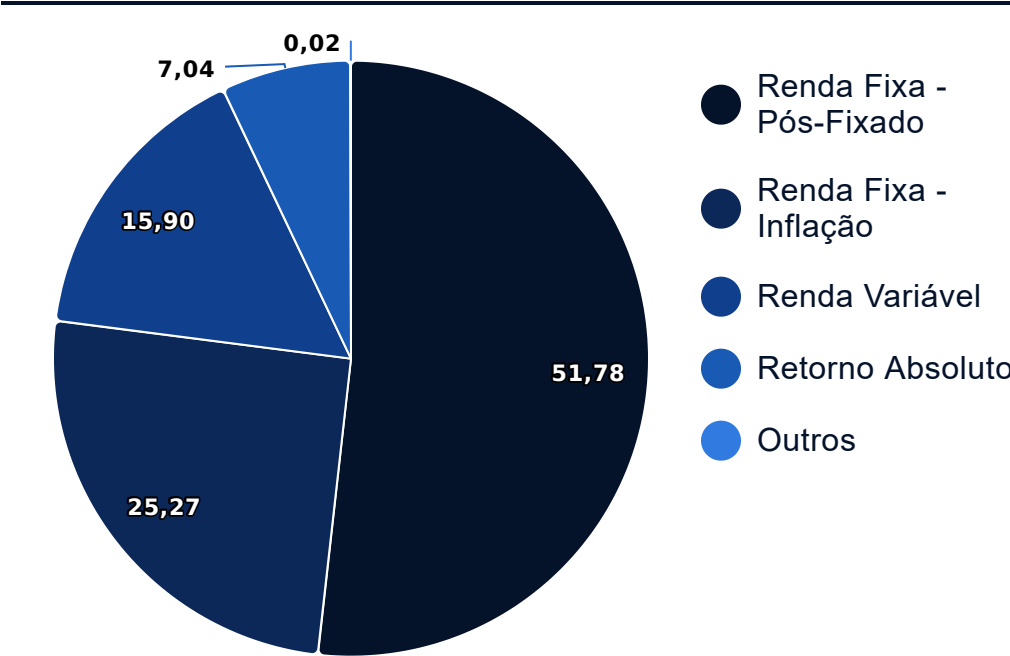
Composição e liquidez da carteira

Data base: 29/12/2023

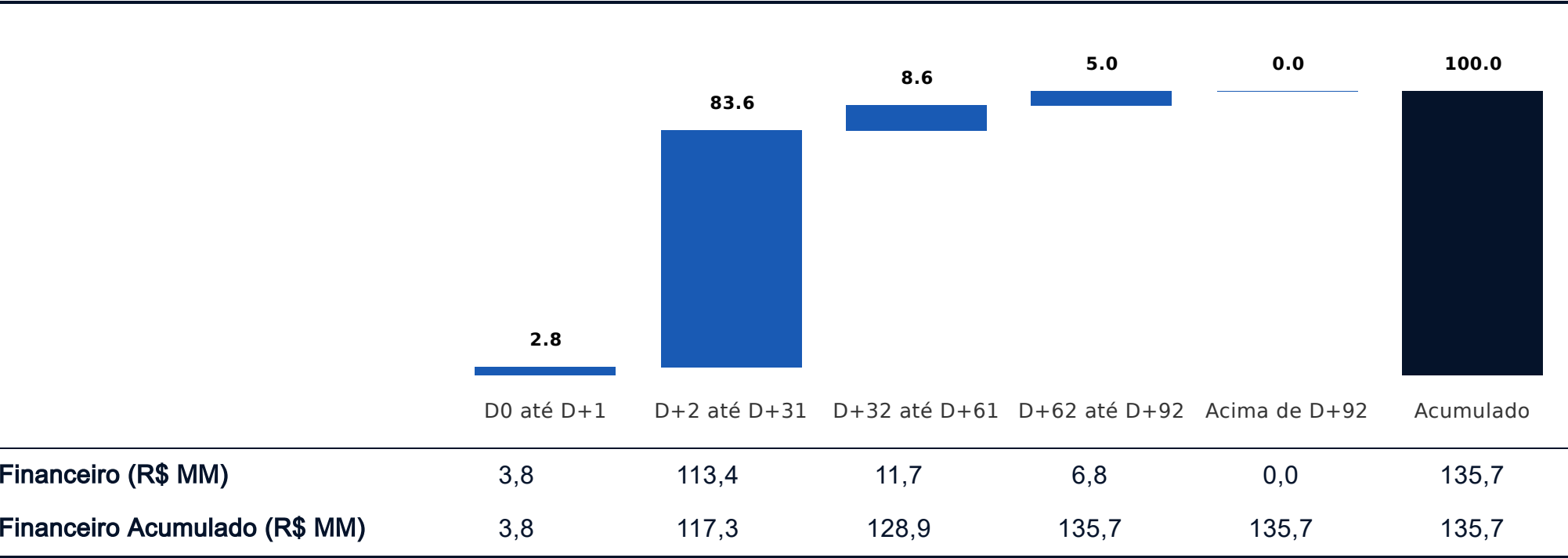
PARTICIPAÇÃO POR CLASSE (% DO PL)

	Dez-22	Jan-23	Fev-23	Mar-23	Abr-23	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23
Renda Fixa - Pós-Fixado	31,09	31,93	42,52	36,05	36,15	29,91	48,90	44,37	48,30	48,45	50,64	48,69	51,78
Renda Fixa - Inflação	55,64	53,75	43,78	51,01	54,42	60,14	39,86	39,60	39,41	39,21	37,38	34,59	25,27
Renda Fixa - Pré-Fixado	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	3,06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Retorno Absoluto	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,85	7,04
Renda Variável	13,28	14,33	13,70	12,93	9,43	9,94	11,23	12,97	12,28	12,34	11,97	13,01	15,90
Outros	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,01	0,01	0,00	0,01	0,00	0,01	1,85	0,02

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE (%)



LIQUIDEZ DA CARTEIRA (%)



Composição e retorno da carteira

Data base: 29/12/2023

ATIVOS

	Emissor	Financeiro (R\$)	% do PL
Renda Fixa - Pós-Fixado		70,265,656.54	51,78%
BTG PAC CORP I FIQRF	BTG PACTUAL AM	66,442,821.21	48,96%
COMPROMISSADA 02/01/2024	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ	3,822,835.33	2,82%
Renda Fixa - Inflação		34,287,164.75	25,27%
TESOURO IPCA GERALRF	BTG PACTUAL AM	20,270,855.18	14,94%
TESOURO IPCA LONGORF	BTG PACTUAL AM	14,016,309.57	10,33%
Retorno Absoluto		9,551,032.52	7,04%
BTG EXPLORER IN FIRF	BTG PACTUAL AM	9,551,032.52	7,04%
Renda Variável		21,574,699.12	15,90%
ABSOLUTO INS FIQ FIA	BTG PACTUAL AM	4,870,852.93	3,59%
SQUADRA INST FIA	SQUADRA INVESTIMENTOS -.	3,551,436.44	2,62%
OCEANA SELECTION P FUNDO DE INVESTIMENTO...	OCEANA INV ADM CARTEIRA VALORES MOBILIARIOS	3,452,502.05	2,54%
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIA	SHARP CAPITAL GEST	3,333,749.29	2,46%
AP INST II FIC FIA	ABSOLUTO PARTNERS	3,235,961.95	2,38%
PS EQ INFLATION FIA	BTG PACTUAL WM.	3,130,196.46	2,31%
Outros		22,532.80	0,02%
FIF UNIPREV III		135,701,085.74	100,00%

ESTATÍSTICAS DOS ATIVOS (%)

Mês	Ano	12M	2022	Desde o 1º Aporte	Vol.3M	Data 1º Aporte
1,11	13,15	13,27	14,24	73,28	0,36	17/02/2017
-	-	-	-	-	-	-
2,72	15,73	15,85	6,01	16,21	4,72	23/09/2022
3,92	18,93	19,05	3,00	5,83	7,35	09/06/2023
1,11	13,17	13,28	-	1,11	1,07	30/11/2023
4,83	15,82	15,69	-4,67	67,66	17,48	23/09/2016
4,44	36,95	37,02	-	19,03	15,70	09/06/2023
6,01	28,75	27,58	4,01	15,77	16,64	09/06/2023
4,65	15,04	14,30	7,77	12,83	17,70	07/06/2023
5,24	22,95	22,10	-14,29	7,90	20,69	09/06/2023
4,85	-	-	-	4,34	14,62	12/12/2023
2,23	13,59	13,68	9,89	895,47	4.69	-

Extrato de movimentações

Data base: 29/12/2023

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	TESOURO IPCA CURTORF	-	30/11/2023	01/12/2023	-	2.500.000,00	7,78
Resgate	TESOURO IPCA CURTORF	-	01/12/2023	04/12/2023	-	2.500.000,00	7,79
Aquisicao	BTG EXPLORER IN FIRF	-	01/12/2023	01/12/2023	-	2.500.000,00	1,13
Resgate	TESOURO IPCA CURTORF	-	04/12/2023	05/12/2023	-	2.634.313,55	7,78
Aquisicao	BTG EXPLORER IN FIRF	-	04/12/2023	04/12/2023	-	2.500.000,00	1,13
Aquisicao	BTG EXPLORER IN FIRF	-	05/12/2023	05/12/2023	-	2.500.000,00	1,13
Resgate	TESOURO IPCA GERALRF	-	08/12/2023	11/12/2023	-	3.000.000,00	5,67
Aquisicao	PS EQ INFLATION FIA	-	12/12/2023	11/12/2023	-	3.000.000,00	1,19
Resgate	TESOURO IPCA GERALRF	-	15/12/2023	18/12/2023	-	4.000.000,00	5,76
Resgate	BTG EXPLORER IN FIRF	-	13/12/2023	14/12/2023	-	550.000,00	1,13
Venda	NTNB IPCA	15/08/2026	-	01/12/2023	330,00	1.401.465,82	12,14
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	04/12/2023	99,00	1.392.203,92	12,14
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	05/12/2023	1.731,00	1.403.986,93	12,14
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	06/12/2023	110,00	1.538.525,15	12,14
Venda	LTN OVER	01/07/2026	-	07/12/2023	1.999,00	1.539.478,48	12,14
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	08/12/2023	1.889,00	1.532.254,48	12,14
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	11/12/2023	1.891,00	1.535.356,86	12,14
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	12/12/2023	109,00	1.532.890,03	12,14
Venda	LTN OVER	01/10/2025	-	13/12/2023	1.845,00	1.536.585,14	12,14
Venda	LTN OVER	01/10/2025	-	14/12/2023	1.783,00	1.487.243,91	12,14
Venda	LTN OVER	01/01/2024	-	18/12/2023	37,00	36.846,83	11,64
Venda	LTN OVER	01/10/2024	-	19/12/2023	4.383,00	4.038.546,78	11,64

Extrato de movimentações

Data base: 29/12/2023

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Venda	NTNB IPCA	15/08/2024	-	20/12/2023	955,00	4.039.585,21	11,64
Venda	LTN OVER	01/10/2024	-	21/12/2023	4.383,00	4.042.320,06	11,64
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	22/12/2023	928,00	4.042.018,46	11,64
Venda	LFT REF	01/09/2028	-	26/12/2023	286,00	4.032.187,23	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	27/12/2023	284,00	4.012.253,67	11,64
Venda	LTN OVER	01/10/2025	-	28/12/2023	4.809,00	4.049.289,42	11,64

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Venda	LTN OVER	01/04/2025	-	02/01/2024	4.328,00	3.824.506,05	11,64
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	03/01/2024	881,00	3.849.172,04	11,64
Venda	LTN OVER	01/04/2025	-	04/01/2024	4.360,00	3.852.634,80	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2026	-	05/01/2024	270,00	3.849.315,11	11,64
Venda	LTN OVER	01/04/2025	-	08/01/2024	4.361,00	3.856.153,51	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2026	-	09/01/2024	269,00	3.838.747,23	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2025	-	10/01/2024	269,00	3.846.676,29	11,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	11/01/2024	271,00	3.851.082,60	11,64

SAC

0800 772 28 27

Ouvidoria

0800 722 00 48

btgpactual.com

