



Relatório de Fundo Exclusivo

FIF UNIPREV III

31 de janeiro de 2024



FIF UNIPREV III

RESUMO DO FUNDO

DATA DE REFERÊNCIA

31/01/2024

PATRIMÔNIO ATUAL (R\$)

135.739.757,43

COTA ATUAL (R\$)

9,9575810

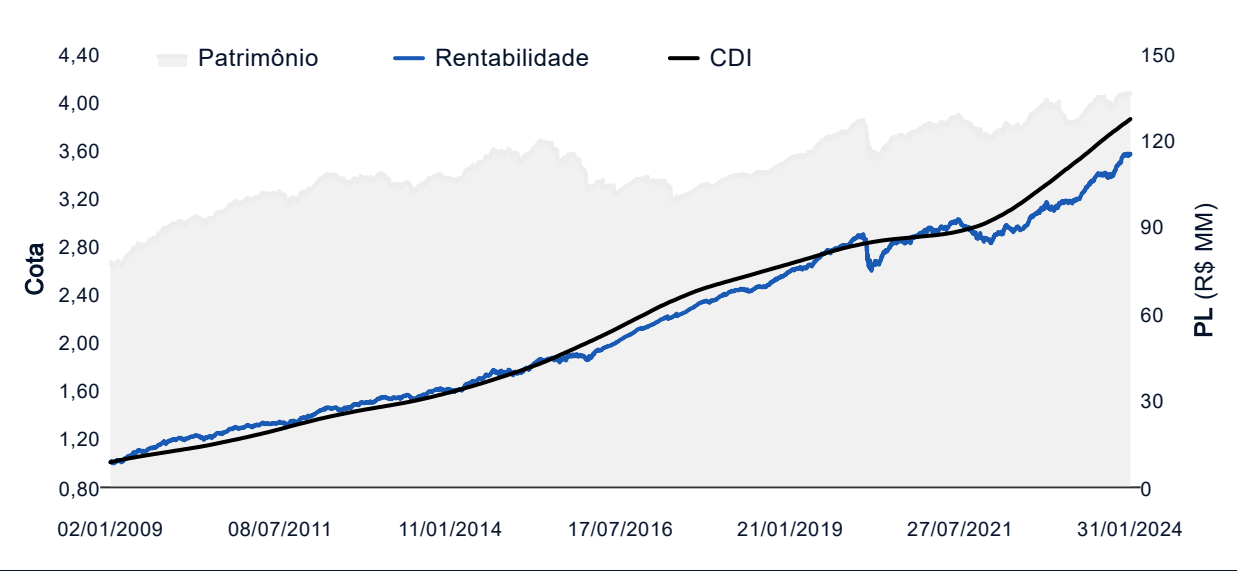
INDICADORES

	Mês	Ano	12M	2023	Início
Rentabilidade (%)	0,03	0,03	12,54	13,59	895,76
% CDI	2,95	2,95	97,01	104,16	108,50
Retorno Real (IPCA + %)	-0,48	-0,48	7,60	8,56	271,32
CDI (%)	0,97	0,97	12,93	13,05	825,56
IPCA (%)	0,51	0,51	4,60	4,64	168,17
IMA-B (%)	-0,45	-0,45	15,64	16,05	1.263,98
IHFA (%)	-0,21	-0,21	7,82	9,28	368,06
IBOV (%)	-4,79	-4,79	13,79	22,28	1.115,07
DOL (%)	2,32	2,32	-2,79	-7,21	38,36

ESTATÍSTICA HISTÓRICA

Meses Negativos	37
Meses Positivos	144
Retorno Mensal Máximo	3,28%
Retorno Mensal Mínimo	-7,36%
Meses Acima do CDI	96
Meses Abaixo do CDI	85
Volatilidade 12 Meses	3,04%
Volatilidade Início	4,20%
Sharpe 3 Meses	3,86

EVOLUÇÃO DA PERFORMANCE E DO PATRIMÔNIO



Resumo da Performance

Data base: 31/01/2024

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												0,03	895,76
CDI	0,97												0,97	825,56

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\$ 131,07 MM.**

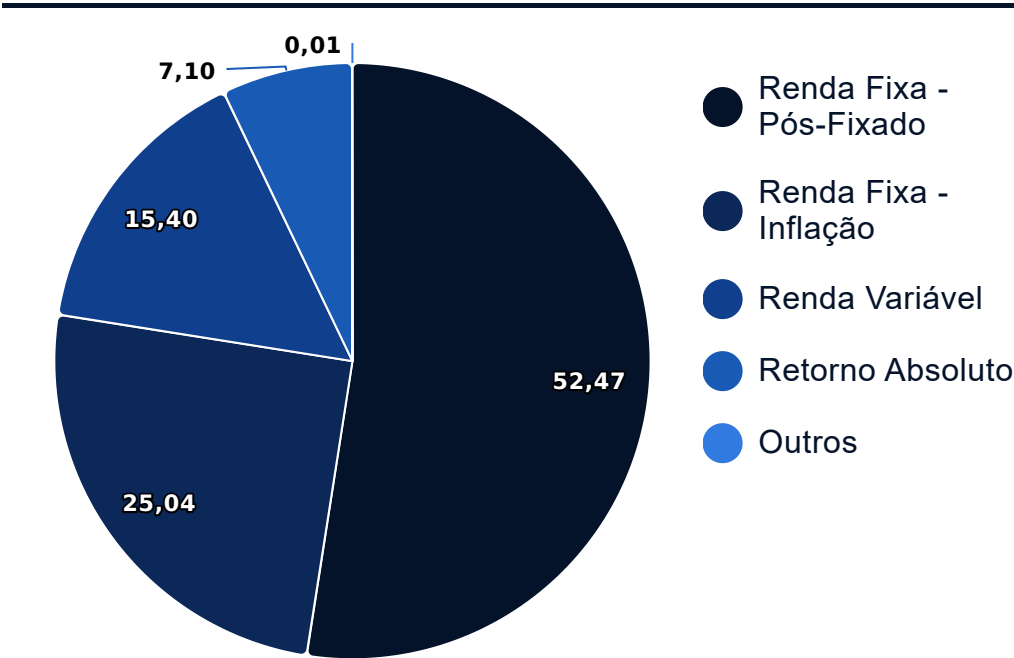
Composição e liquidez da carteira

Data base: 31/01/2024

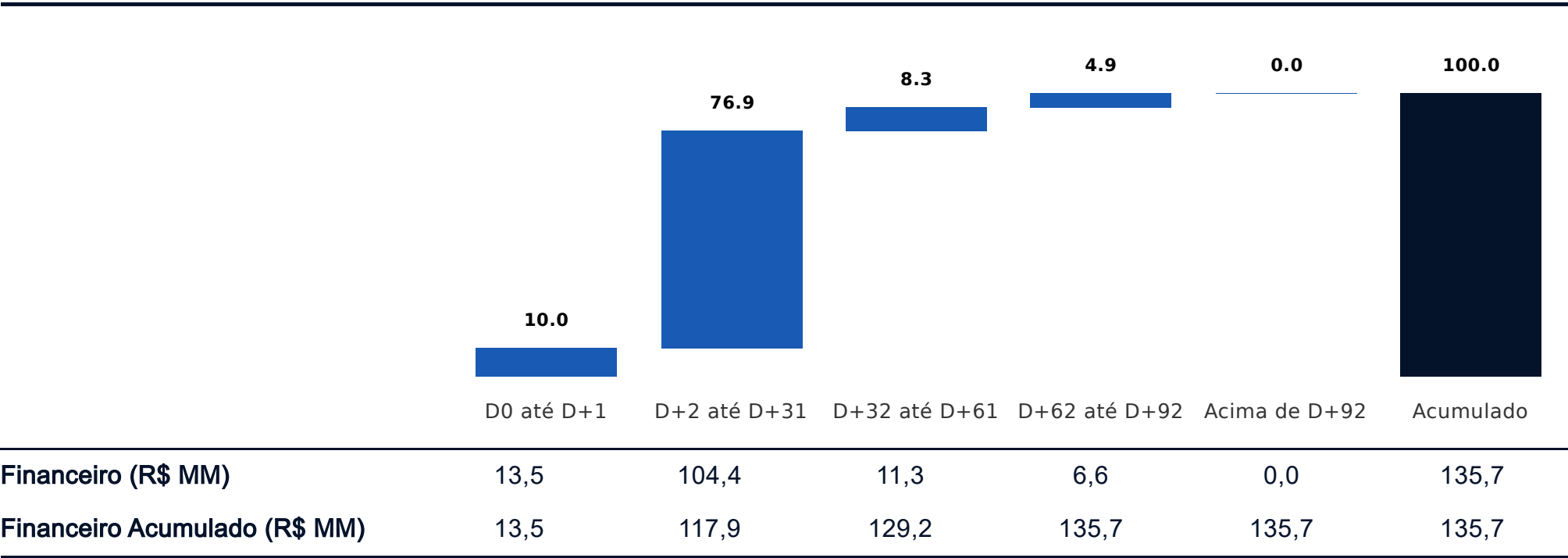
PARTICIPAÇÃO POR CLASSE (% DO PL)

	Jan-23	Fev-23	Mar-23	Abr-23	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24
Renda Fixa - Pós-Fixado	44,12	42,52	39,31	39,98	39,75	48,90	47,43	48,30	50,44	50,64	49,73	51,78	52,47
Renda Fixa - Inflação	41,55	43,78	47,75	50,59	50,30	39,86	39,60	39,41	37,22	37,38	33,56	25,27	25,04
Renda Fixa - Pré-Fixado	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	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	1,85	7,04	7,10
Renda Variável	14,33	13,70	12,93	9,43	9,94	11,23	12,97	12,28	12,34	11,97	13,01	15,90	15,40
Outros	0,00	0,00	0,00	0,00	0,01	0,01	0,00	0,01	0,00	0,01	1,85	0,02	0,01

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE (%)



LIQUIDEZ DA CARTEIRA (%)



Composição e retorno da carteira

Data base: 31/01/2024

ATIVOS

	Emissor	Financeiro (R\$)	% do PL
Renda Fixa - Pós-Fixado		71,216,665.98	52,47%
BTG PAC CORP I FIQRF	BTG PACTUAL AM	67,349,389.19	49,62%
COMPROMISSADA 01/02/2024	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ	3,867,276.79	2,85%
Renda Fixa - Inflação		33,982,460.20	25,04%
TESOURO IPCA GERALRF	BTG PACTUAL AM	20,174,909.84	14,86%
TESOURO IPCA LONGORF	BTG PACTUAL AM	13,807,550.37	10,17%
Retorno Absoluto		9,630,881.61	7,10%
BTG EXPLORER IN FIRF	BTG PACTUAL AM	9,630,881.61	7,10%
Renda Variável		20,901,556.14	15,40%
ABSOLUTO INS FIQ FIA	BTG PACTUAL AM	4,706,772.42	3,47%
SQUADRA INST FIA	SQUADRA INVESTIMENTOS -.	3,487,065.90	2,57%
OCEANA SELECTION P FUNDO DE INVESTIMENTO...	OCEANA INV ADM CARTEIRA VALORES MOBILIARIOS	3,343,464.53	2,46%
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIA	SHARP CAPITAL GEST	3,225,297.07	2,38%
AP INST II FIC FIA	ABSOLUTO PARTNERS	3,096,502.75	2,28%
PS EQ INFLATION FIA	BTG PACTUAL WM.	3,042,453.47	2,24%
Outros		8,178.68	0,01%
FIF UNIPREV III		135,739,742.61	100,00%

ESTATÍSTICAS DOS ATIVOS (%)

Mês	Ano	12M	2023	Desde o 1º Aporte	Vol.3M	Data 1º Aporte
1,36	1,36	15,21	13,15	75,64	0,33	17/02/2017
-	-	-	-	-	-	-
-0,47	-0,47	15,31	15,73	15,66	3,37	23/09/2022
-1,49	-1,49	18,86	18,93	4,25	5,47	09/06/2023
0,84	0,84	12,92	13,17	1,95	0,59	30/11/2023
-3,37	-3,37	7,47	15,82	62,01	15,83	23/09/2016
-1,81	-1,81	28,84	36,95	16,88	14,86	09/06/2023
-3,16	-3,16	22,07	28,75	12,11	15,26	09/06/2023
-3,25	-3,25	9,94	15,04	9,16	15,41	07/06/2023
-4,31	-4,31	12,77	22,95	3,25	18,29	09/06/2023
-2,80	-2,80	-	-	1,42	10,77	12/12/2023
0,03	0,03	12,54	13,59	895,76	4.20	-

Extrato de movimentações

Data base: 31/01/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	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
Venda	LFT REF	01/03/2026	-	12/01/2024	269,00	3.843.988,48	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2025	-	15/01/2024	269,00	3.851.715,05	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2025	-	16/01/2024	269,00	3.853.421,08	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2026	-	17/01/2024	269,00	3.849.292,28	11,64
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	18/01/2024	271,00	3.860.006,95	11,64
Venda	NTNB IPCA	15/08/2028	-	19/01/2024	890,00	3.862.735,20	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	22/01/2024	272,00	3.859.519,37	11,64
Venda	LTN OVER	01/07/2027	-	23/01/2024	5.475,00	3.867.692,08	11,64
Venda	LFT REF	01/09/2028	-	24/01/2024	271,00	3.855.943,58	11,64
Venda	NTNB IPCA	15/08/2024	-	25/01/2024	901,00	3.870.437,75	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2030	-	26/01/2024	273,00	3.866.391,42	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	29/01/2024	271,00	3.867.444,92	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2025	-	30/01/2024	268,00	3.856.097,37	11,64
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	31/01/2024	888,00	3.869.617,97	11,64

Extrato de movimentações

Data base: 31/01/2024

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	ABSOLUTO INS FIQ FIA	-	15/02/2024	19/02/2024	-	600.000,00	3,70
Resgate	ABSOLUTO INS FIQ FIA	-	16/02/2024	20/02/2024	-	600.000,00	3,70
Venda	NTNB IPCA	15/08/2024	-	01/02/2024	900,00	3.868.966,93	11,64
Venda	LFT REF	01/03/2025	-	02/02/2024	268,00	3.861.027,58	11,14
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	05/02/2024	4.669,00	3.875.554,51	11,14
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	06/02/2024	890,00	3.874.116,10	11,14
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	07/02/2024	888,00	3.876.561,59	11,14

SAC

0800 772 28 27

Ouvidoria

0800 722 00 48

btgpactual.com

