



Relatório de Fundo Exclusivo

FIF UNIPREV III

31 de maio de 2024



FIF UNIPREV III

RESUMO DO FUNDO

DATA DE REFERÊNCIA

31/05/2024

PATRIMÔNIO ATUAL (R\$)

135.512.662,17

COTA ATUAL (R\$)

10,0816979

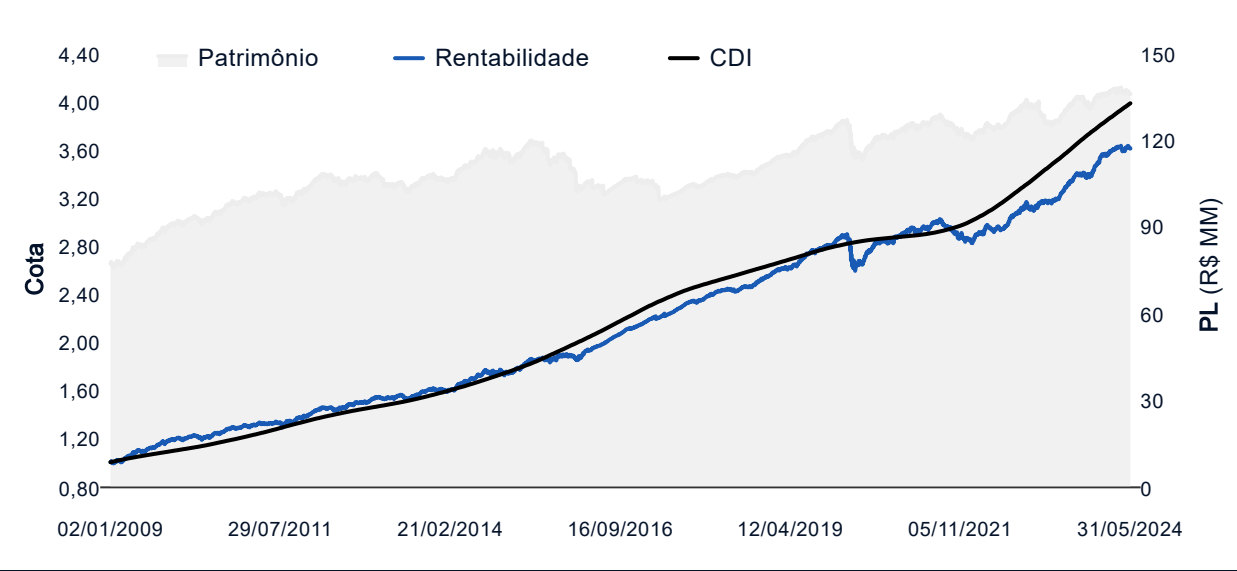
INDICADORES

	Mês	Ano	12M	2023	Início
Rentabilidade (%)	0,61	1,28	10,77	13,59	908,17
% CDI	73,33	29,00	89,30	104,16	105,97
Retorno Real (IPCA + %)	0,20	-1,04	6,71	8,56	269,25
CDI (%)	0,83	4,40	12,06	13,05	857,01
IPCA (%)	0,41	2,33	3,81	4,64	173,03
IMA-B (%)	1,33	-0,13	6,55	16,05	1.268,34
IHFA (%)	0,28	-0,44	5,98	9,28	366,98
IBOV (%)	-3,04	-9,01	12,05	22,28	1.061,29
DOL (%)	1,35	8,27	3,60	-7,21	46,41

ESTATÍSTICA HISTÓRICA

Meses Negativos	38
Meses Positivos	147
Retorno Mensal Máximo	3,28%
Retorno Mensal Mínimo	-7,36%
Meses Acima do CDI	97
Meses Abaixo do CDI	88
Volatilidade 12 Meses	2,99%
Volatilidade Início	4,17%
Sharpe 3 Meses	-3,97

EVOLUÇÃO DA PERFORMANCE E DO PATRIMÔNIO



Resumo da Performance

Data base: 31/05/2024

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	0,61								1,28	908,17
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83								4,40	857,01

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\$ 134,34 MM.**

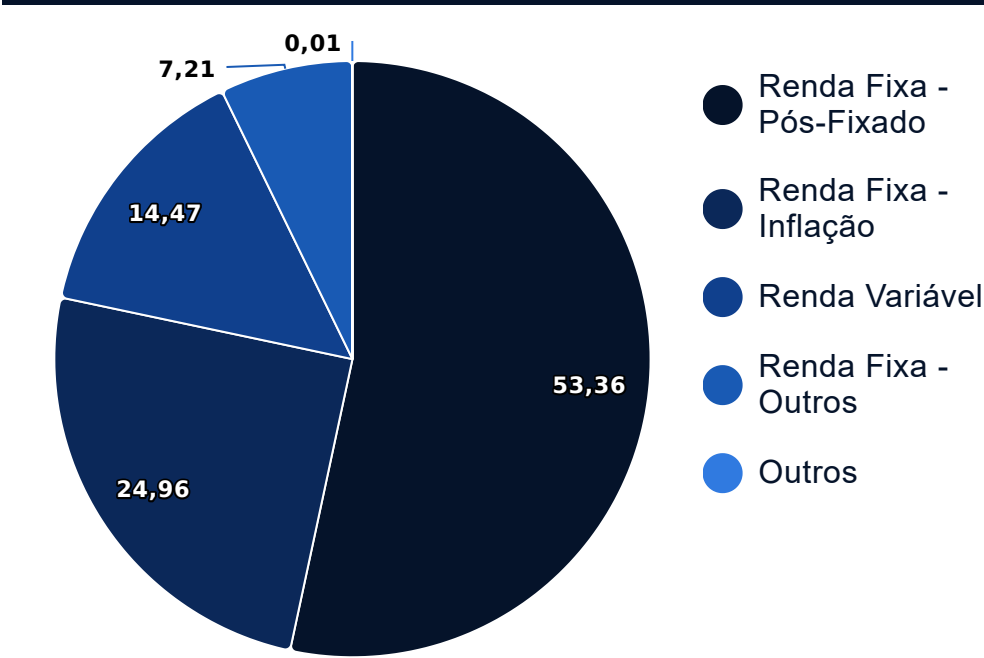
Composição e liquidez da carteira

Data base: 31/05/2024

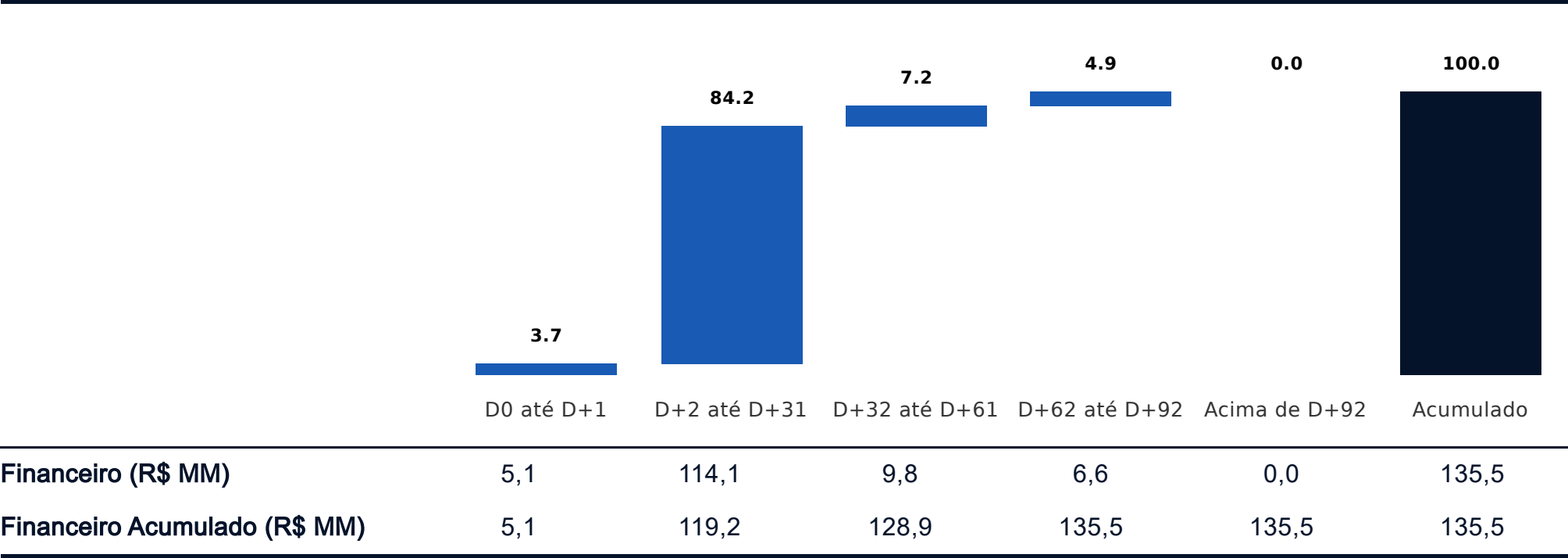
PARTICIPAÇÃO POR CLASSE (% DO PL)

	Mai-23	Jun-23	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24
Renda Fixa - Pós-Fixado	39,75	48,90	47,43	48,30	50,44	50,64	49,73	51,78	52,47	52,53	52,63	53,56	53,36
Renda Fixa - Inflação	50,30	39,86	39,60	39,41	37,22	37,38	33,56	25,27	25,04	24,92	24,79	24,57	24,96
Renda Fixa - Outros	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	1,85	7,04	7,10	7,08	7,10	7,14	7,21
Renda Variável	9,94	11,23	12,97	12,28	12,34	11,97	13,01	15,90	15,40	15,47	15,47	14,73	14,47
Outros	0,01	0,01	0,00	0,01	0,00	0,01	1,85	0,02	0,01	0,00	0,00	0,00	0,01

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE (%)



LIQUIDEZ DA CARTEIRA (%)



Composição e retorno da carteira

Data base: 31/05/2024

ATIVOS

	Emissor	Financeiro (R\$)	% do PL
Renda Fixa - Pós-Fixado		72,302,821.09	53,36%
BTG PAC CORP I FIQRF	BTG PACTUAL AM	67,263,487.54	49,64%
COMPROMISSADA 03/06/2024	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ	5,039,333.55	3,72%
Renda Fixa - Inflação		33,819,620.45	24,96%
TESOURO IPCA GERALRF	BTG PACTUAL AM	20,217,403.24	14,92%
TESOURO IPCA LONGORF	BTG PACTUAL AM	13,602,217.21	10,04%
Renda Fixa - Outros		9,769,572.98	7,21%
BTG EXPLORER IN FIRF	BTG PACTUAL AM	9,769,572.98	7,21%
Renda Variável		19,603,173.80	14,47%
SQUADRA INST FIA	SQUADRA INVESTIMENTOS -.	3,506,233.98	2,59%
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIA	SHARP CAPITAL GEST	3,292,748.52	2,43%
PS EQ INFLATION FIA	BTG PACTUAL WM.	3,268,920.76	2,41%
ABSOLUTO INS FIQ FIA	BTG PACTUAL AM	3,240,032.69	2,39%
OCEANA SELECTION P FUNDO DE INVESTIMENT...	OCEANA INV ADM CARTEIRA VALORES MOBILIARIOS	3,220,645.36	2,38%
AP INST II FIC FIA	ABSOLUTO PARTNERS	3,074,592.50	2,27%
Outros		17,459.03	0,01%
FIF UNIPREV III		135,512,647.35	100,00%

ESTATÍSTICAS DOS ATIVOS (%)

Mês	Ano	12M	2023	Desde o 1º Aporte	Vol.3M	Data 1º Aporte
0,94	5,81	16,60	13,15	83,34	0,26	17/02/2017
-	-	-	-	-	-	-
1,31	-0,26	6,22	15,73	15,91	2,93	23/09/2022
1,57	-2,95	3,94	18,93	2,70	4,73	09/06/2023
0,87	2,29	9,09	13,17	3,42	1,91	30/11/2023
-0,18	-6,53	17,55	36,95	11,26	12,61	09/06/2023
-1,22	-6,91	9,69	15,04	5,03	12,45	07/06/2023
-0,39	-7,68	7,00	-	-3,67	11,71	12/12/2023
-3,92	-11,63	4,63	15,82	48,16	12,76	23/09/2016
-4,13	-11,92	8,28	28,75	1,97	13,64	09/06/2023
-1,77	-10,70	3,21	22,95	-3,64	15,44	09/06/2023
0,61	1,28	10,77	13,59	908,17	4.17	-

Extrato de movimentações

Data base: 31/05/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	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
Venda	LTN OVER	01/07/2027	-	08/05/2024	8.535,00	6.054.594,10	10,64
Venda	LFT REF	01/09/2028	-	09/05/2024	412,00	6.046.518,92	10,64
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	10/05/2024	7.201,00	6.052.140,62	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	13/05/2024	411,00	6.026.211,58	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	14/05/2024	412,00	6.032.915,55	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	15/05/2024	411,00	6.031.053,55	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	16/05/2024	362,00	5.331.123,35	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	17/05/2024	363,00	5.330.926,19	10,39
Venda	LTN OVER	01/01/2030	-	20/05/2024	10.197,00	5.345.229,91	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	21/05/2024	362,00	5.337.312,73	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	22/05/2024	362,00	5.339.411,21	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2028	-	23/05/2024	341,00	5.024.179,13	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	24/05/2024	341,00	5.033.565,79	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	27/05/2024	340,00	5.034.333,52	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	28/05/2024	342,00	5.035.474,95	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	29/05/2024	342,00	5.029.284,48	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	31/05/2024	342,00	5.031.228,42	10,39

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	BTG EXPLORER IN FIRF	-	06/06/2024	07/06/2024	-	9.780.616,10	1,17

Extrato de movimentações

Data base: 31/05/2024

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	TESOURO IPCA GERALRF	-	11/06/2024	12/06/2024	-	5.000.000,00	5,76
Resgate	TESOURO IPCA LONGORF	-	11/06/2024	12/06/2024	-	3.000.000,00	2,74
Resgate	BTG PAC CORP I FIQRF	-	10/07/2024	11/07/2024	-	500.000,00	3,34
Aquisicao	TESOURO IPCA CURTORF	-	12/06/2024	12/06/2024	-	15.000.000,00	8,10
Resgate	TESOURO IPCA GERALRF	-	13/06/2024	14/06/2024	-	2.500.000,00	5,75
Resgate	TESOURO IPCA LONGORF	-	13/06/2024	14/06/2024	-	2.500.000,00	2,73
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	03/06/2024	342,00	5.041.310,66	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	04/06/2024	342,00	5.043.265,58	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	05/06/2024	342,00	5.045.292,56	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	06/06/2024	340,00	5.034.616,98	10,39
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	06/06/2024	17,00	14.315,28	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	07/06/2024	342,00	5.041.276,14	10,39
Venda	LTN OVER	01/01/2030	-	10/06/2024	28.386,00	14.829.920,79	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	11/06/2024	1.000,00	14.825.453,54	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	12/06/2024	1.004,00	14.840.211,84	10,39
Venda	LTN OVER	01/04/2025	-	13/06/2024	8.556,00	7.844.868,14	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2026	-	14/06/2024	525,00	7.836.265,45	10,39

SAC

0800 772 28 27

Ouvidoria

0800 722 00 48

btgpactual.com

