



Relatório de Fundo Exclusivo

FIF UNIPREV III

31 de julho de 2024



FIF UNIPREV III

RESUMO DO FUNDO

DATA DE REFERÊNCIA

31/07/2024

PATRIMÔNIO ATUAL (R\$)

137.401.135,72

COTA ATUAL (R\$)

10,2907755

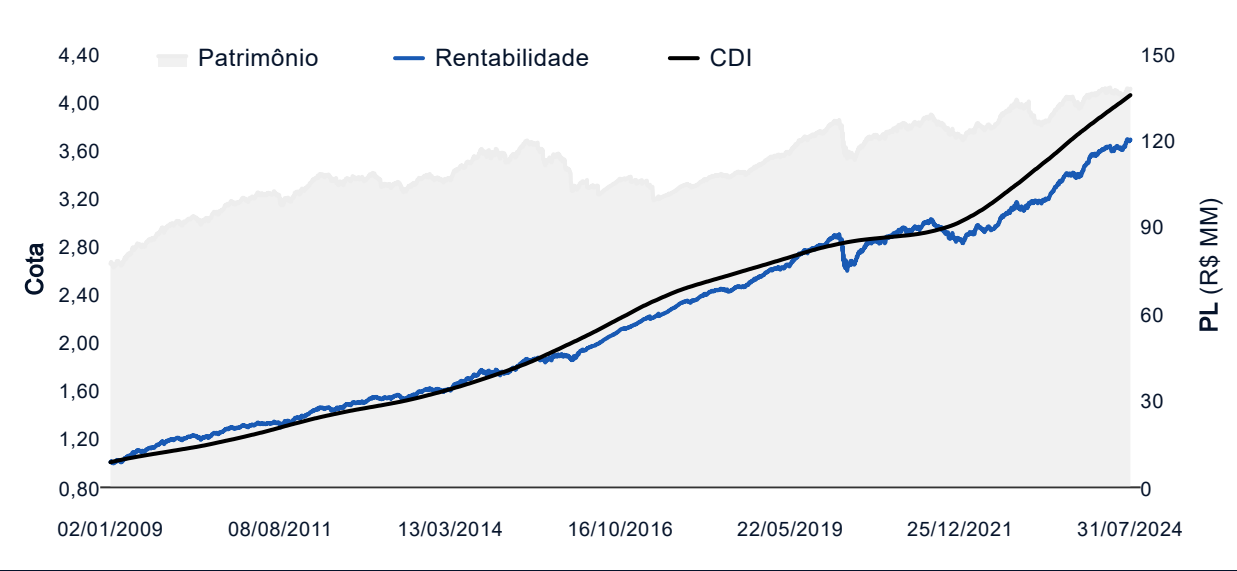
INDICADORES

	Mês	Ano	12M	2023	Início
Rentabilidade (%)	1,64	3,38	9,12	13,59	929,08
% CDI	180,59	54,66	78,83	104,16	106,39
Retorno Real (IPCA + %)	1,34	0,40	4,56	8,56	274,60
CDI (%)	0,91	6,18	11,57	13,05	873,31
IPCA (%)	0,29	2,97	4,36	4,64	174,72
IMA-B (%)	2,09	0,97	4,66	16,05	1.283,47
IHFA (%)	1,51	1,83	5,79	9,28	377,61
IBOV (%)	3,02	-4,87	6,21	22,28	1.114,11
DOL (%)	1,86	16,95	19,83	-7,21	58,15

ESTATÍSTICA HISTÓRICA

Meses Negativos	38
Meses Positivos	149
Retorno Mensal Máximo	3,28%
Retorno Mensal Mínimo	-7,36%
Meses Acima do CDI	98
Meses Abaixo do CDI	89
Volatilidade 12 Meses	2,99%
Volatilidade Início	4,16%
Sharpe 3 Meses	-0,45

EVOLUÇÃO DA PERFORMANCE E DO PATRIMÔNIO



Resumo da Performance

Data base: 31/07/2024

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	0,43	1,64						3,38	929,08
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79	0,91						6,18	873,31

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\$ 135,11 MM.**

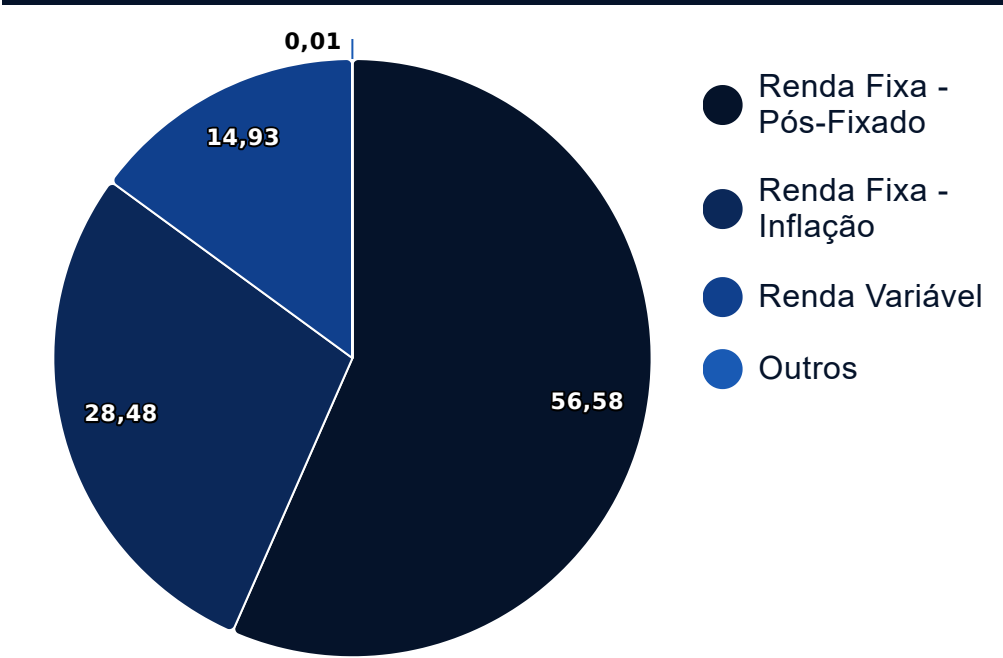
Composição e liquidez da carteira

Data base: 31/07/2024

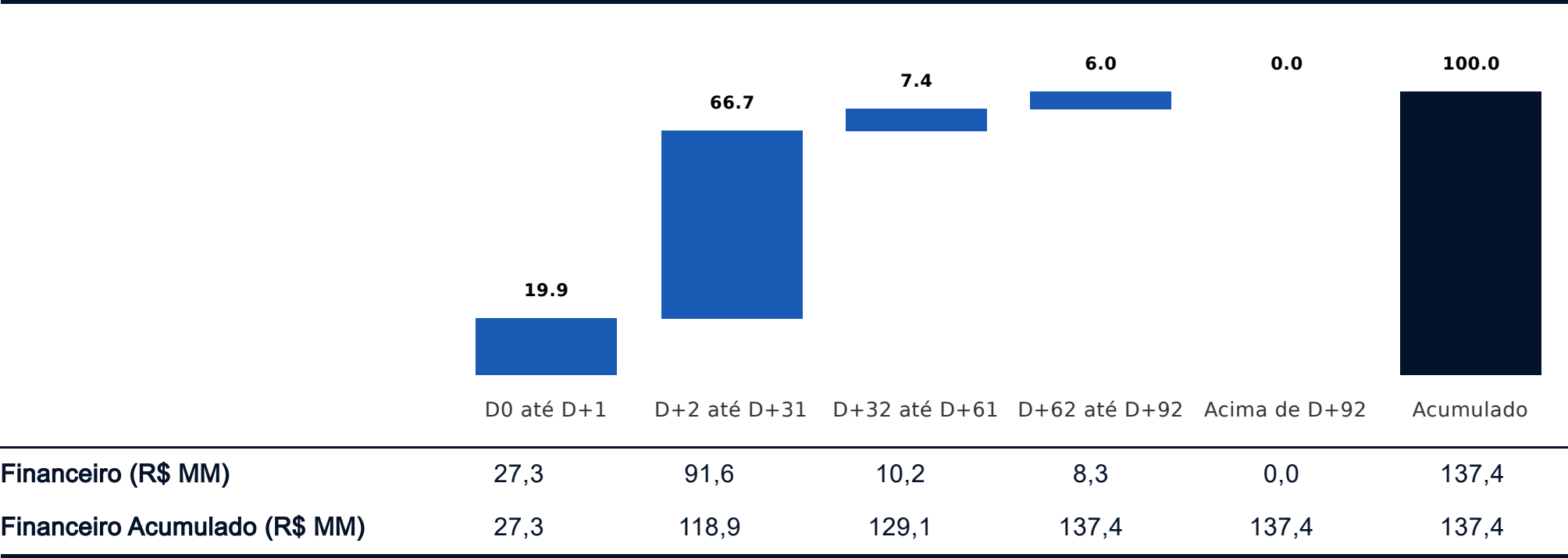
PARTICIPAÇÃO POR CLASSE (% DO PL)

	Jul-23	Ago-23	Set-23	Out-23	Nov-23	Dez-23	Jan-24	Fev-24	Mar-24	Abr-24	Mai-24	Jun-24	Jul-24
Renda Fixa - Pós-Fixado	47,43	48,30	50,44	50,64	49,73	51,78	52,47	52,53	52,63	53,56	53,36	56,86	56,58
Renda Fixa - Inflação	39,60	39,41	37,22	37,38	33,56	25,27	25,04	24,92	24,79	24,57	24,96	28,44	28,48
Retorno Absoluto	0,00	0,00	0,00	0,00	1,85	7,04	7,10	7,08	7,10	7,14	7,21	0,00	0,00
Renda Variável	12,97	12,28	12,34	11,97	13,01	15,90	15,40	15,47	15,47	14,73	14,47	14,68	14,93
Outros	0,00	0,01	0,00	0,01	1,85	0,02	0,01	0,00	0,00	0,00	0,01	0,02	0,01

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE (%)



LIQUIDEZ DA CARTEIRA (%)



Composição e retorno da carteira

Data base: 31/07/2024

ATIVOS

	Emissor	Financeiro (R\$)	% do PL
Renda Fixa - Pós-Fixado		77,734,921.17	56,58%
BTG PAC CORP I FIQRF	BTG PACTUAL AM	67,154,359.65	48,87%
COMPROMISSADA 01/08/2024	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ	10,580,561.52	7,70%
Renda Fixa - Inflação		39,134,491.86	28,48%
TESOURO IPCA CURTORF	BTG PACTUAL AM	16,736,237.88	12,18%
TESOURO IPCA GERALRF	BTG PACTUAL AM	13,803,054.71	10,05%
TESOURO IPCA LONGORF	BTG PACTUAL AM	8,595,199.26	6,26%
Renda Variável		20,520,760.82	14,93%
SQUADRA INST FIA	SQUADRA INVESTIMENTOS -.	3,635,705.72	2,65%
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIA	SHARP CAPITAL GEST	3,442,980.48	2,51%
OCEANA SELECTION P FUNDO DE INVESTIMENT...	OCEANA INV ADM CARTEIRA VALORES MOBILIARIOS	3,404,487.66	2,48%
ABSOLUTO INS FIQ FIA	BTG PACTUAL AM	3,380,769.38	2,46%
AP INST II FIC FIA	ABSOLUTO PARTNERS	3,198,537.81	2,33%
PS EQ INFLATION FIA	BTG PACTUAL WM.	2,025,891.98	1,47%
PS ATMOS INST FICFIA	ATMOS CAPITAL GESTAO DE RECURSOS LTDA	1,432,387.79	1,04%
Outros		10,947.04	0,01%
FIF UNIPREV III		137,401,120.90	100,00%

ESTATÍSTICAS DOS ATIVOS (%)

Mês	Ano	12M	2023	Desde o 1º Aporte	Vol.3M	Data 1º Aporte
1,13	8,01	15,56	13,15	87,16	0,22	17/02/2017
-	-	-	-	-	-	-
0,90	4,14	8,07	11,90	1,45	1,53	12/06/2024
2,04	0,75	4,28	15,73	17,08	3,80	23/09/2022
3,21	-2,12	1,14	18,93	3,59	6,12	09/06/2023
4,03	-3,08	8,85	36,95	15,36	14,62	09/06/2023
2,86	-2,66	2,06	15,04	9,83	14,26	07/06/2023
3,75	-6,89	2,88	28,75	7,79	15,48	09/06/2023
2,14	-7,80	-2,40	15,82	54,59	13,54	23/09/2016
2,83	-7,10	-5,57	22,95	0,24	16,44	09/06/2023
5,31	-1,69	7,44	-	2,57	13,57	12/12/2023
1,91	-4,13	-0,91	25,50	-1,21	14,60	18/07/2024
1,64	3,38	9,12	13,59	929,08	4.16	-

Extrato de movimentações

Data base: 31/07/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	BTG PAC CORP I FIQRF	-	10/07/2024	11/07/2024	-	500.000,00	3,36
Resgate	BTG PAC CORP I FIQRF	-	18/07/2024	19/07/2024	-	1.000.000,00	3,37
Aquisicao	PS ATMOS INST FICFIA	-	18/07/2024	17/07/2024	-	1.450.000,00	1,17
Resgate	PS EQ INFLATION FIA	-	18/07/2024	22/07/2024	-	1.450.000,00	1,21
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	01/07/2024	605,00	8.974.091,43	10,39
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	02/07/2024	2.127,00	8.988.589,04	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2027	-	03/07/2024	602,00	8.993.555,74	10,39
Venda	LTN OVER	01/07/2026	-	04/07/2024	11.372,00	8.998.466,00	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	05/07/2024	604,00	8.988.359,00	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	08/07/2024	606,00	9.007.853,77	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2025	-	09/07/2024	599,00	9.010.406,41	10,39
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	10/07/2024	2.114,00	9.019.759,07	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	11/07/2024	601,00	9.019.118,45	10,39
Venda	NTNB IPCA	15/08/2030	-	12/07/2024	2.216,00	9.530.067,98	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	15/07/2024	640,00	9.533.611,91	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	16/07/2024	640,00	9.537.689,42	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	17/07/2024	640,00	9.541.622,44	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	18/07/2024	542,00	8.083.893,53	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2027	-	19/07/2024	538,00	8.091.262,12	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2030	-	22/07/2024	611,00	9.090.449,93	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	23/07/2024	706,00	10.543.240,72	10,39
Venda	LTN OVER	01/07/2026	-	24/07/2024	13.180,00	10.559.464,40	10,39

Extrato de movimentações

Data base: 31/07/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Venda	LTN OVER	01/01/2028	-	25/07/2024	15.879,00	10.563.928,82	10,39
Venda	LFT REF	01/06/2030	-	26/07/2024	708,00	10.560.454,38	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	29/07/2024	706,00	10.560.637,03	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	30/07/2024	706,00	10.564.883,26	10,39
Venda	LTN OVER	01/01/2030	-	31/07/2024	20.355,00	10.580.534,75	10,39

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	ABSOLUTO INS FIQ FIA	-	19/08/2024	21/08/2024	-	700.000,00	3,43
Resgate	AP INST II FIC FIA	-	17/09/2024	19/09/2024	-	500.000,00	0,87
Venda	LTN OVER	01/01/2030	-	01/08/2024	20.266,00	10.584.712,66	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	02/08/2024	706,00	10.577.525,44	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	05/08/2024	706,00	10.581.992,04	10,39

SAC

0800 772 28 27

Ouvidoria

0800 722 00 48

btgpactual.com

