



Relatório de Fundo Exclusivo

FIF UNIPREV III

28 de junho de 2024



FIF UNIPREV III

RESUMO DO FUNDO

DATA DE REFERÊNCIA

28/06/2024

PATRIMÔNIO ATUAL (R\$)

135.186.543,57

COTA ATUAL (R\$)

10,1249117

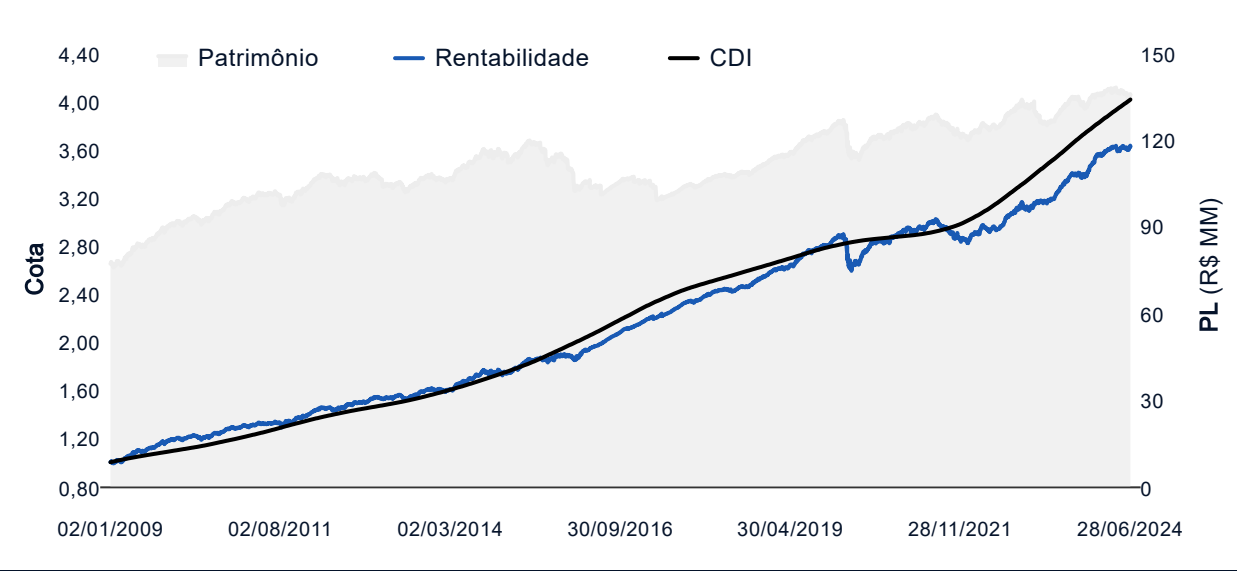
INDICADORES

	Mês	Ano	12M	2023	Início
Rentabilidade (%)	0,43	1,71	9,41	13,59	912,49
% CDI	54,37	32,74	79,32	104,16	105,54
Retorno Real (IPCA + %)	0,07	-0,97	5,11	8,56	269,50
CDI (%)	0,79	5,22	11,86	13,05	864,56
IPCA (%)	0,36	2,70	4,09	4,64	174,01
IMA-B (%)	-0,97	-1,10	3,93	16,05	1.255,10
IHFA (%)	0,65	0,21	5,45	9,28	370,02
IBOV (%)	1,48	-7,66	5,43	22,28	1.078,49
DOL (%)	6,05	14,82	16,04	-7,21	55,27

ESTATÍSTICA HISTÓRICA

Meses Negativos	38
Meses Positivos	148
Retorno Mensal Máximo	3,28%
Retorno Mensal Mínimo	-7,36%
Meses Acima do CDI	97
Meses Abaixo do CDI	89
Volatilidade 12 Meses	3,01%
Volatilidade Início	4,17%
Sharpe 3 Meses	-3,69

EVOLUÇÃO DA PERFORMANCE E DO PATRIMÔNIO



Resumo da Performance

Data base: 28/06/2024

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							1,71	912,49
CDI	0,97	0,80	0,83	0,89	0,83	0,79							5,22	864,56

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\$ 134,70 MM.**

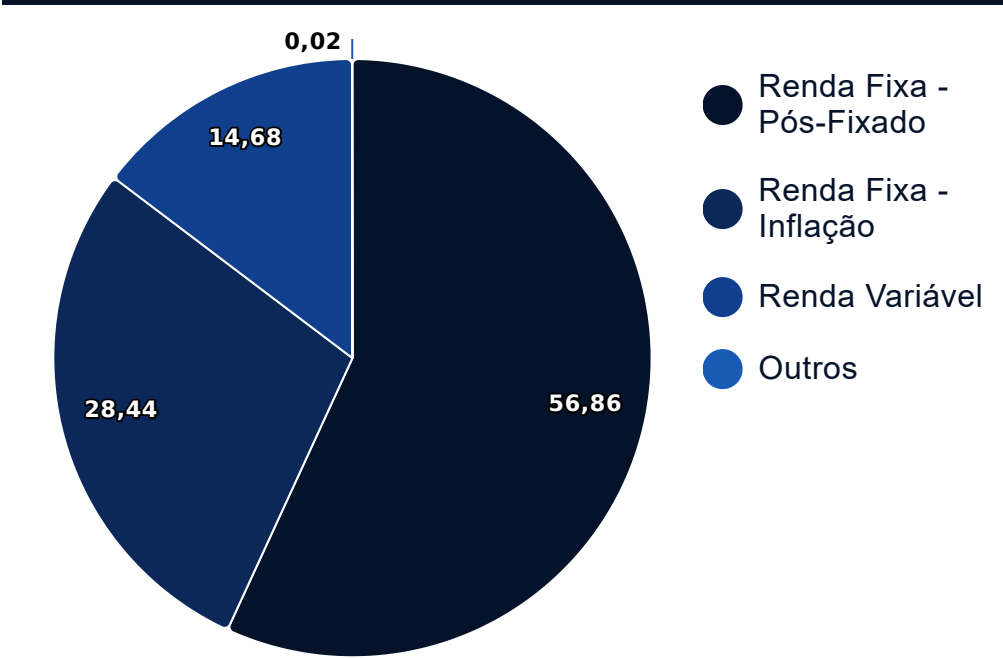
Composição e liquidez da carteira

Data base: 28/06/2024

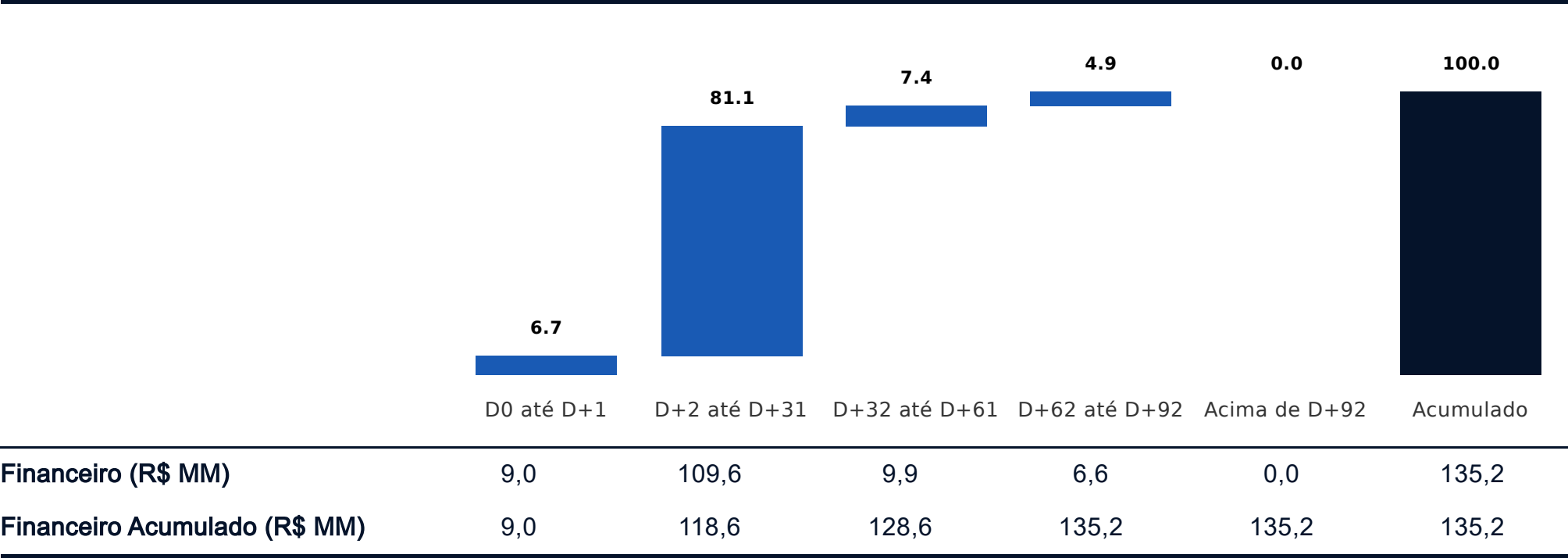
PARTICIPAÇÃO POR CLASSE (% DO PL)

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

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR CLASSE (%)



LIQUIDEZ DA CARTEIRA (%)



Composição e retorno da carteira

Data base: 28/06/2024

ATIVOS

	Emissor	Financeiro (R\$)	% do PL
Renda Fixa - Pós-Fixado		76,866,155.93	56,86%
BTG PAC CORP I FIQRF	BTG PACTUAL AM	67,895,583.97	50,22%
COMPROMISSADA 01/07/2024	BACEN-BANCO CENTRAL DO BRASIL - RJ	8,970,571.95	6,64%
Renda Fixa - Inflação		38,443,110.08	28,44%
TESOURO IPCA CURTORF	BTG PACTUAL AM	16,587,320.93	12,27%
TESOURO IPCA GERALRF	BTG PACTUAL AM	13,527,535.06	10,01%
TESOURO IPCA LONGORF	BTG PACTUAL AM	8,328,254.09	6,16%
Renda Variável		19,848,922.08	14,68%
SQUADRA INST FIA	SQUADRA INVESTIMENTOS -.	3,494,725.67	2,59%
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FIA	SHARP CAPITAL GEST	3,347,114.59	2,48%
ABSOLUTO INS FIQ FIA	BTG PACTUAL AM	3,309,801.10	2,45%
PS EQ INFLATION FIA	BTG PACTUAL WM.	3,305,263.32	2,44%
OCEANA SELECTION P FUNDO DE INVESTIMENT...	OCEANA INV ADM CARTEIRA VALORES MOBILIARIOS	3,281,377.93	2,43%
AP INST II FIC FIA	ABSOLUTO PARTNERS	3,110,639.48	2,30%
Outros		28,340.67	0,02%
FIF UNIPREV III		135,186,528.75	100,00%

ESTATÍSTICAS DOS ATIVOS (%)

Mês	Ano	12M	2023	Desde o 1º Aporte	Vol.3M	Data 1º Aporte
0,94	6,80	16,26	13,15	85,07	0,24	17/02/2017
-	-	-	-	-	-	-
0,38	3,21	8,21	11,90	0,55	1,63	12/06/2024
-1,00	-1,26	3,60	15,73	14,75	3,44	23/09/2022
-2,27	-5,16	-0,38	18,93	0,37	5,52	09/06/2023
-0,33	-6,84	10,73	36,95	10,89	14,63	09/06/2023
1,65	-5,37	4,54	15,04	6,77	14,32	07/06/2023
2,15	-9,73	-0,17	15,82	51,35	13,99	23/09/2016
1,11	-6,65	4,08	-	-2,60	13,58	12/12/2023
1,89	-10,26	2,87	28,75	3,90	16,23	09/06/2023
1,17	-9,65	-2,46	22,95	-2,51	16,94	09/06/2023
0,43	1,71	9,41	13,59	912,49	4.17	-

Extrato de movimentações

Data base: 28/06/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qtd	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	BTG EXPLORER IN FIRF	-	06/06/2024	07/06/2024	-	9.780.616,10	1,17
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
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
Aquisicao	TESOURO IPCA CURTORF	-	18/06/2024	18/06/2024	-	1.500.000,00	8,12
Aquisicao	TESOURO IPCA GERALRF	-	18/06/2024	18/06/2024	-	1.000.000,00	5,76
Aquisicao	TESOURO IPCA LONGORF	-	18/06/2024	18/06/2024	-	500.000,00	2,74
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
Venda	LFT REF	01/06/2030	-	17/06/2024	811,00	11.943.775,15	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	18/06/2024	807,00	11.946.469,02	10,39

Extrato de movimentações

Data base: 28/06/2024

MOVIMENTAÇÕES REALIZADAS (MÊS)

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Venda	LFT REF	01/09/2024	-	19/06/2024	598,00	8.952.445,59	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	20/06/2024	602,00	8.949.103,58	10,39
Venda	LTN OVER	01/01/2026	-	21/06/2024	10.665,00	8.967.205,00	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2028	-	24/06/2024	602,00	8.956.116,04	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	25/06/2024	605,00	8.973.627,07	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	26/06/2024	605,00	8.963.129,03	10,39
Venda	LFT REF	01/03/2029	-	27/06/2024	605,00	8.980.845,06	10,39
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	28/06/2024	605,00	8.970.389,72	10,39

MOVIMENTAÇÕES AGENDADAS

Movimentação	Ativo	Vencimento	Cotização	Liquidação	Qty	Valor (R\$)	PU/Taxa
Resgate	BTG PAC CORP I FIQRF	-	10/07/2024	11/07/2024	-	500.000,00	3,35
Resgate	BTG PAC CORP I FIQRF	-	18/07/2024	19/07/2024	-	1.000.000,00	3,35
Venda	LFT REF	01/09/2029	-	01/07/2024	605,00	8.974.091,43	10,39

SAC

0800 772 28 27

Ouvidoria

0800 722 00 48

btgpactual.com

