

Objetivos do Fundo

Fundo que busca superar o CDI no longo prazo, atuando nos mercados de juros e índices de preços locais, com flexibilidade para atuar no mercado internacional de juros e moedas. O processo de investimento possui foco intenso em pesquisa para discussão e construção dos cenários local e internacional.

81,13% do CDI

Rentabilidade no ano

88,41% do CDI

Rentabilidade dos últimos 12 meses

118,02% do CDI

Rentabilidade desde o início do fundo

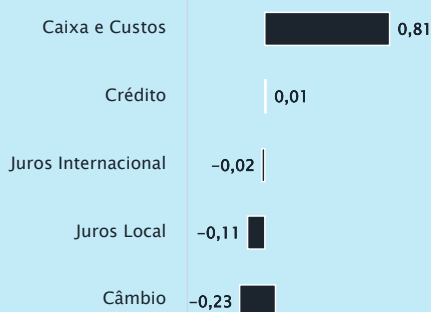
Análise de Retorno

Termômetro de Risco



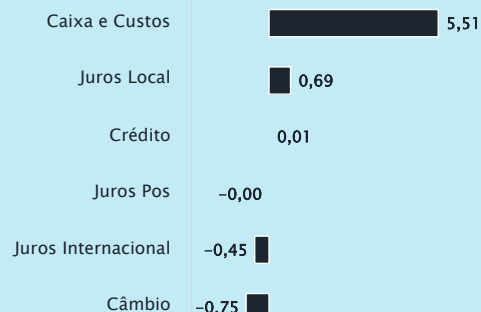
Contribuição no retorno no mês

Nominal em %



Contribuição no retorno no ano

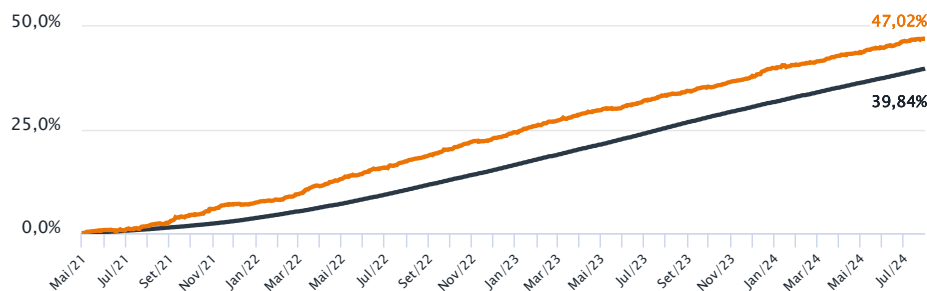
Nominal em %



Retorno Acumulado

Data de início do fundo
30/04/2021

Itaú Optimus RF LP
CDI



Retorno Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2024	Fundo 0,58%	0,50%	0,93%	0,65%	0,80%	0,97%	0,46%	-	-	-	-	-	5,01%
	CDI 0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	-	-	-	-	-	6,18%
	%CDI 59,99%	62,90%	112,05%	73,64%	96,51%	123,38%	50,56%	-	-	-	-	-	81,13%
2023	Fundo 1,30%	0,89%	1,14%	0,81%	0,56%	1,24%	1,08%	0,75%	0,75%	0,87%	0,86%	1,59%	12,51%
	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%
	%CDI 116,00%	97,01%	97,08%	88,19%	50,13%	115,34%	100,35%	66,16%	76,78%	87,29%	93,73%	177,90%	95,85%
2022	Fundo 0,65%	1,17%	1,82%	1,55%	1,24%	1,23%	1,26%	1,19%	1,33%	1,48%	0,66%	1,25%	15,87%
	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%
	%CDI 89,29%	156,20%	196,93%	185,38%	120,42%	121,10%	121,72%	101,84%	124,24%	144,76%	64,90%	111,19%	128,28%

Comentários do Gestor

39

Meses desde o início do fundo



Meses em que esteve acima do benchmark



Meses de retorno positivo do fundo

0,96%

Volatilidade 12 meses

Atribuição de performance:

No mês de julho, o mercado de moedas foi marcado por uma grande dispersão de retorno entre os grupos de moedas de caráter mais e menos cíclico. Nesse contexto, as estratégias no livro de moedas apresentaram resultados negativos, com destaque para as posições compradas em peso mexicano, dólar neozelandês e coroa norueguesa, e das posições vendidas em iene japonês e franco suíço. Em contrapartida, os ganhos nas posições vendidas em coroa sueca, dólar canadense e libra esterlina conseguiram compensar parte das perdas. No mercado internacional, vimos dados na direção de uma economia americana mais balanceada, tanto na atividade como na inflação, o que possibilitou o FOMC sinalizar que os ajustes na taxa de juros estão mais próximos. Na estratégia de juros internacional, atuamos com uma visão de uma abordagem mais tática nos mercados de juros de países emergentes e desenvolvidos, sendo o resultado negativo do livro advindo, majoritariamente, das posições tomadas em juros da zona do euro e Estados Unidos, que foram parcialmente compensadas pelo ganho obtido em posição aplicada em juros no México. No mercado de juros local, ao longo do mês de julho, os dados de atividade da economia brasileira surpreenderam positivamente em todos os setores da economia, assim como no mercado de trabalho, o que acabou ocasionando pequenas perdas nas posições tomadas na parte intermediária da curva de juros e nas posições comparadas em inflação de curto prazo.

Posicionamento:

Juros Brasil - Permanecemos com posição comprada em inflação e tomados na parte intermediária da curva de juros.

Juros Internacional - De maneira tática, temos operado com viés aplicador em juros nas economias desenvolvidas e emergentes.

Moedas - Em agosto, iniciamos o mês com viés vendido em dólar, operando de forma tática.

Características



<p>Este Material refere-se ao fundo investido pela Itaú Vida e Previdência S.A. para gestão das provisões dos planos.</p>	<p>Taxa de Administração cobrada 0,90% ao ano</p> <p>Taxa de Performance 20.0% sobre o que exceder 100% do CDI</p> <p>Público Alvo Previdenciário</p>	<p>Processo SUSEP VGBL** 15414002714/2004-08 / 15414605493/2021-17</p> <p>Processo SUSEP PGBL** 15414002714/2004-08 / 15414605491/2021-28 15414601881/2022-18</p>
<p>Patrimônio Líquido Médio Últimos 12 meses R\$ 10.926.389.800,27</p>		

O fundo poderá, eventualmente, apresentar indisponibilidade, permanente ou temporária, de acesso por parte de investidores. Em caso de dúvidas, consulte seu gerente de relacionamento

Acesse outros documentos relevantes deste fundo: www.itaub.com.br/investimentos-previdencia/fundos/informacoes-cotistas/

Glossário: LF - Letra Financeira. CDB - Certificado de Depósito Bancário. LSF - Letra Financeira Subordinada. LFSN - Letra Financeira Elegível - Nível II. DEB - Debentures. NP - Notas Promissórias. CCB - Cédula de Crédito Bancário. FIDC - Fundo de Investimento em Direitos Creditórios. DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial. Debentures Conversível. Certificado de Recebíveis Imobiliários. LC - Letra de Câmbio. LCA - Letra de Crédito Agrícola. LCI - Letra de Crédito Imobiliário. DEB COMP - Debenture Compromissada. CDB Vinc - Certificado de Depósito Interbancário Vinculado. CRI - Certificado de Recebíveis Imobiliário. CDCA - Certificado de Direitos Creditórios do Agronegócio. CPR - Contas a Pagar e Receber. DPGE - Depósito a Prazo com Garantia Especial. COMPR - Operação Compromissada. LH - Letra Hipotecária. TERMO - Contrato a Termo



Signatory of:



Informações relevantes

ITAÚ FLEXPREV OPTIMUS RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO - CNPJ 40.616.111/0001-41 - 31/07/2024

Este fundo é supervisionado e fiscalizado pela Comissão de Valores Mobiliários - CVM (Serviço de atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br). Público alvo: O FUNDO destina-se a receber, com exclusividade, os recursos das provisões matemáticas e demais recursos e provisões de Planos Geradores de Benefícios Livre - PGBL e Vida Geradores de Benefícios Livre - VGBL, instituídos pela Itaú Vida e Previdência S.A., investidor profissional, nos termos da regulamentação em vigor. Objetivo do fundo: O objetivo do FUNDO é aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como "Renda Fixa", observado que a rentabilidade do FUNDO será impactada pelos custos e despesas do FUNDO, inclusive taxa de administração. Tipo Anbima: PREVIDÊNCIA RF DURAÇÃO LIVRE GRAU DE INVESTIMENTO - Por meio de uma carteira composta no mínimo 80% da carteira em títulos públicos federais, ativos com baixo risco de crédito do mercado doméstico ou externo, o FUNDO tem como objetivo buscar retorno por meio de investimentos em ativos de renda fixa, admitindo-se estratégias que impliquem risco de juros e de índice de preços. São admitidos ativos de renda fixa emitidos no exterior. Excluem-se estratégias que impliquem exposição de renda variável (ações, etc.). Por se tratar de Renda Fixa Ativos Duração Livre tem como objetivo buscar retorno por meio de investimentos em ativos e derivativos de renda fixa, sem compromisso de manter limites mínimo ou máximo para a duração média ponderada da carteira. O hedge cambial da parcela de ativos no exterior é facultativo. Início do fundo em: 30/04/2021. Taxa de Administração máx.: 0.90%. Taxa de Performance: 20.0% do que exceder 100.0% do CDI. Fonte de dados do material: Itaú Asset Management. Material de divulgação do fundo - A Itaú Asset Management é a gestora de fundos de investimentos do Itaú Unibanco. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento antes de investir. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. Para obter mais informações, entre em contato pelo telefone (11) 3631-2555. Consultas, sugestões, reclamações, críticas, elogios e denúncias, utilize o SAC: 0800 728 0728, todos os dias, 24 horas, ou o canal Fale Conosco (www.itaub.com.br). Se necessário contate a Ouvidoria Corporativa Itaú: 0800 570 0011 (em dias úteis das 9h às 18h) ou Caixa Postal 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, todos os dias, 24 horas, 0800 722 1722.

Outras informações relevantes

Itaú Vida e Previdência S.A.: CNPJ: 92.661.388/0001-90. Informações reduzidas. Prevalcem os termos dos regulamentos que você recebe na contratação dos planos, de acordo com a legislação vigente. O regulamento do plano poderá ser consultado no portal da Susep - www.susep.gov.br. Os recursos dos planos de previdência são aplicados em fundos de investimento, que não possuem garantia de rentabilidade, podendo, inclusive, ter rentabilidade negativa e possuem patrimônio segregado do patrimônio da EAFC. O registro desses planos na Susep não implica, por parte da autarquia, incentivo ou recomendação à sua comercialização. Os planos de previdência apresentam tributação no resgate ou recebimento de renda, conforme sua escolha na contratação: tributação progressiva compensável ou tributação regressiva definitiva. A rentabilidade do fundo será impactada em virtude dos custos e despesas do fundo, inclusive taxa de administração. O índice utilizado trata-se de mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance. Clientes Personalitê: Consultas, informações e serviços transacionais acesse itaupersonnalite.com.br ou ligue 3003 7377 (capitais e regiões metropolitanas) ou 0800 724 7377 (demais localidades), todos os dias, 24 horas por dia ou fale com seu gerente. Reclamações, cancelamentos e informações gerais ligue para o SAC: 0800 722 7377, todos os dias, 24 horas por dia. Se não ficar satisfeito com a solução apresentada, contate a Ouvidoria: 0800 570 0011, em dias úteis, das 9h às 18h.