

# Itaú Lumina Soberano RF LP FICFI



31 de Outubro de 2024

## Objetivos do Fundo

Fundo que busca superar o CDI no longo prazo a partir de atuação conservadora nos mercados locais de juros e de inflação, com a flexibilidade para assumir posições em juros internacionais através da B3. Não tem exposição ao mercado de crédito privado.

Como diferencial, time de gestão experiente e com longa história de atuação conjunta. Foco em performance consistente no longo prazo, com um processo de investimento disciplinado e no qual as abordagens qualitativa e sistemática são adotadas de forma complementar.

**88,02% do CDI**

Rentabilidade no ano

**89,91% do CDI**

Rentabilidade dos últimos 12 meses

**90,11% do CDI**

Rentabilidade desde o início do fundo

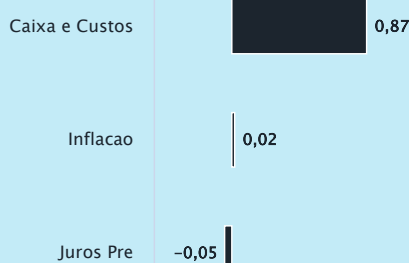
## Análise de Retorno

Termômetro de Risco



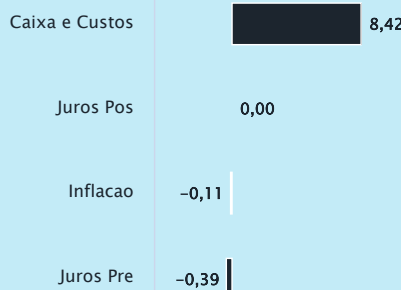
### Contribuição no retorno no mês

Nominal em %

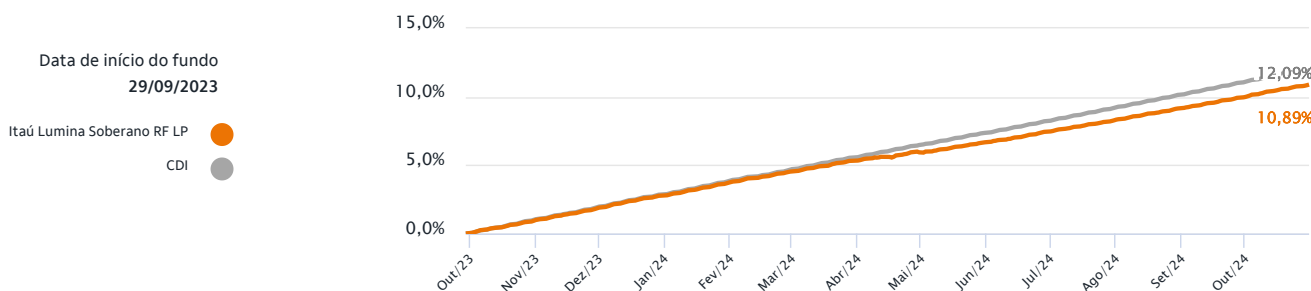


### Contribuição no retorno no ano

Nominal em %



## Retorno Acumulado



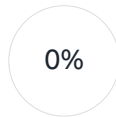
## Retorno Mensal

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
Fundo	0,93%	0,78%	0,75%	0,60%	0,69%	0,72%	0,79%	0,80%	0,75%	0,85%	-	-	7,92%
2024 CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	0,93%	-	-	8,99%
%CDI	96,46%	97,50%	89,94%	67,09%	83,22%	90,77%	86,64%	91,90%	89,70%	91,27%	-	-	88,02%
Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,93%	0,91%	0,89%	2,76%
2023 CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,92%	0,90%	2,84%
%CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	93,03%	99,40%	99,49%	97,14%

## Comentários do Gestor

13

Meses desde o início do fundo



Meses em que esteve acima do benchmark



Meses de retorno positivo do fundo

0,22%

Volatilidade 12 meses

Em outubro, no Brasil, incertezas sobre o cenário fiscal e uma pressão inflacionária persistente indicam que o Copom deve aumentar a Selic em 0,50 p.p. na próxima reunião, mantendo investidores cautelosos. A inflação ao consumidor superou as expectativas, com o IPCA-15 registrando uma alta de 0,54% em outubro, refletindo pressões inflacionárias no curto prazo. O mercado de trabalho continua forte, com criação significativa de novos empregos e uma taxa de desemprego em queda. No mês, o IMA-B, que reflete a composição da dívida pública com indexação pela inflação, teve retorno negativo de -0,65%, enquanto o IMA-B 5, que reflete os títulos com vencimento em até 5 anos, subiu 0,74%. O IRF-M rendeu 0,21% contra 0,98% do IMA-S e 0,93% do CDI.

**Posicionamento na Renda Fixa** - Considerando a possibilidade de resultados mais altos do IPCA no curto prazo, de acordo com a previsão do nosso time de economistas, tivemos no portfólio operações de compra de inflação implícita curta e compras de NTN-B 2026/2027. Como acreditamos numa atuação austera do Copom com o ritmo de alta da taxa Selic em suas próximas reuniões, também atuamos pessimistas no Pré curto (tomados em taxa), acreditando na redução da inclinação da curva de juros e venda de inflação implícita mais longa (2028). O conjunto das operações trouxe impactos negativos.

## Características



<b>Volume Global Mínimo*</b> R\$ 1,00	<b>Taxa de Administração cobrada</b> 0,45% ao ano	<b>Horário para Movimentação</b> Até às 15:00
<b>Classificação Tributária</b> Longo Prazo	<b>Taxa de Performance</b> Não há	<b>Aplicação e Resgate</b> Cota de aplicação: D+0
<b>Patrimônio Líquido Médio</b> Últimos 12 meses R\$ 9.083.269,94	<b>Público Alvo</b> Público Em Geral	<b>Cota de Resgate (dias úteis): D+0</b> <b>Crédito do Resgate (dias úteis após cotização): D+0</b>

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.itaú.com.br/investimentos-previdencia/fundos/informacoes-cotistas/](http://www.itaú.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 - Debênture 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 LUMINA SOBERANO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO DA CLASSE DE INVESTIMENTO EM COTAS RESPONSABILIDADE LIMITADA CNPJ 52.151.906/0001-00 - 31/10/2024

Este fundo possui lâmina de informações essenciais, podendo esta ser consultada no seguinte endereço eletrônico [www.itaú.com.br](http://www.itaú.com.br). Os rendimentos serão tributados semestralmente, no último dia útil dos meses de maio e novembro, à alíquota de 15%. No momento do resgate, será aplicada a alíquota complementar em função do prazo da aplicação: até 180 dias, 22,5%; de 181 a 360 dias, 20%; de 361 a 720 dias, 17,5%; acima de 720 dias, 15%. Haverá cobrança de IOF regressivo no caso de resgates de aplicações com menos de 30 dias. Público alvo: O FUNDO, a critério do ADMINISTRADOR, receberá recursos de fundos de investimento, pessoas físicas e jurídicas, clientes do ADMINISTRADOR, do GESTOR ou de controladas, direta ou indiretamente, pela Itaú Unibanco Holding S.A. 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: RENDA FIXA - DURAÇÃO MÉDIA - SOBERANO - Fundos que devem manter 100% (cem por cento) em títulos públicos federais. Fundos que têm como objetivo buscar retornos investindo em ativos e derivativos de renda fixa. Esses Fundos devem possuir duration média ponderada da carteira inferior ou igual à apurada no IRF-M do último dia útil do mês de junho. Estes Fundos buscam limitar oscilação nos retornos decorrentes das alterações nas taxas de juros futuros. Fundos que possuírem ativos no exterior deverão realizar o hedge cambial desta parcela. Excluem-se estratégias que impliquem exposição em moeda estrangeira. Início do fundo em: 29/09/2023. Taxa de Administração máx.: 0.45%. Taxa de Performance: Não há. 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. Dúvidas, sugestões e reclamações, fale com o seu Private Banker. Se necessário, utilize o SAC Itaú 0800 728 0728, todos os dias, 24h, ou o Fale Conosco Itaú Private Bank ([www.itauprivatebank.com.br](http://www.itauprivatebank.com.br)). Se desejar a reavaliação da solução apresentada após utilizar esses canais, recorra à Ouvidoria Corporativa Itaú 0800 570 0011, dias úteis, das 9 às 18h, Caixa Postal nº 67.600, CEP 03162-971. Deficientes auditivos ou de fala, 24h por dia, 7 dias por semana, 0800 722 1722.