

## CARTA MENSAL – AGOSTO/2022

No mercado internacional, os ativos de risco globais foram impactados principalmente pela persistência dos temores de recessão global e pela indicação de uma política monetária mais restritiva pelo FED, resultando em quedas das bolsas, títulos soberanos e cestas de *commodities*, com destaque para metais e energia; a moeda americana se fortaleceu contra seus principais pares no mês devido ao aumento da aversão ao risco. No ambiente doméstico, sucessivos índices de inflação em terreno negativo suportaram a expectativa de que o ciclo de alta da Selic tenha sido encerrado na última reunião, o que favoreceu a queda das taxas de juros e a alta da bolsa. O mercado acionário ainda foi favorecido pelo forte fluxo estrangeiro que superou R\$ 16 bi em agosto, de forma que o Ibovespa registrou a maior alta mensal desde janeiro. Dentre os fatores que adicionaram volatilidade ao mercado local, destacam-se as discussões para flexibilização do teto de gastos e as alterações no Auxílio Brasil.

AGOSTO/2022	29/JULHO	Máximo	Mínimo	31/AGOSTO	Oscilação
IBOVESPA	103.165	113.813	102.225	109.523	+6,16%
IBOVESPA (DOL)	19.942	22.335	19.579	21.128	+5,95%
DOLAR (PTAX)	5,19	5,28	5,04	5,18	-0,18%
Pré Jan/23	13,79	13,82	13,70	13,74	-5 bps
Pré Jan/25	12,68	12,68	11,65	11,97	-71 bps
Pré Jan/29	12,71	12,78	11,59	11,90	-81 bps

Fonte: Bloomberg

**Alaska Institucional e Previdenciários:** as carteiras de ações apresentaram desempenhos positivos, porém inferiores ao Ibovespa no mês. As posições no setor óleo e gás foram os destaques positivos, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico. Em agosto, as participações no setor de serviços aumentaram, enquanto as participações no setor de logística foram reduzidas. Empresas do setor de *commodities* seguem como as maiores posições da carteira de ações.

**Fundos Alaska Black BDR:** além da carteira de ações que apresentou desempenho positivo no mês, os fundos carregam posição comprada na bolsa local via opções, que também contribuiu de forma positiva. No mercado de juros, a principal fonte de ganhos foi a posição direcional vendida em taxa na parte intermediária da curva. Em câmbio, o fundo segue com posição vendida em dólar contra o real.

**Alaska Range:** o fundo apresentou retorno positivo em renda variável, com ganhos na posição direcional em bolsa local e perdas na estratégia *long & short* entre a carteira de ações e o índice. Em juros, o fundo teve ganhos tanto na posição direcional vendida em taxa na parte intermediária da curva quanto nas posições de arbitragem. Em câmbio, o fundo seguiu com a posição vendida em dólar contra o real.

AGOSTO/2022	CNPJ	Renda Variável	Juros	Câmbio	Caixa	Custos*	Total
Alaska Institucional FIA	26.673.556/0001-32	+5,39%	-	-	+0,24%	-0,19%	<b>+5,21%</b>
Alaska Black FIC FIA - BDR Nível I	12.987.743/0001-86	+7,17%	+0,63%	+0,09%	+0,24%	-0,22%	<b>+7,91%</b>
Alaska Black FIC FIA II - BDR Nível I	26.648.868/0001-96	+7,16%	+0,63%	+0,09%	+0,20%	-0,20%	<b>+7,91%</b>
Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM	29.722.458/0001-36	+3,57%	-	-	+0,38%	-0,30%	<b>+3,65%</b>
Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM	34.081.155/0001-11	+5,11%	-	-	+0,01%	-0,28%	<b>+4,84%</b>
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 70	32.761.323/0001-94	+3,42%	-	-	+0,38%	-0,21%	<b>+3,59%</b>
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100	32.757.743/0001-05	+4,90%	-	-	+0,01%	-0,21%	<b>+4,70%</b>
Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM	35.939.700/0001-20	+3,40%	-	-	+0,38%	-0,25%	<b>+3,53%</b>
Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM	35.939.857/0001-56	+4,90%	-	-	+0,01%	-0,30%	<b>+4,62%</b>
Alaska Previdência 70 FIC FIM	41.881.132/0001-57	+3,59%	-	-	+0,38%	-0,30%	<b>+3,67%</b>
Alaska Previdência 100 FIC FIM	37.313.900/0001-07	+5,14%	-	-	+0,02%	-0,19%	<b>+4,97%</b>
Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM	39.254.233/0001-56	+3,56%	-	-	+0,39%	-0,33%	<b>+3,62%</b>
Alaska Range FIM	13.001.211/0001-90	+1,79%	+0,33%	+0,01%	+0,95%	-0,19%	<b>+2,88%</b>

\*Aqui estão incluídas as taxas de administração e performance, despesas de auditoria e encargos regulatórios.

FUNDO	CNPJ	DATA	ESTRATÉGIA	COTA	DIA	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	DESDE O INÍCIO	INÍCIO DO FUNDO	PATRIMÔNIO
Alaska Institucional FIA IBOVESPA	26.673.556/0001-32	31/08/2022	Ações	2,75052720	-0,61%	5,21%	4,94%	2,37%	16,04%	175,05%	21-fev-2017	1.288.264.567,96
Alaska Black FIC FIA - BDR Nível I* IPCA + 6%	12.987.743/0001-86	31/08/2022	Ações	2,47821940	-2,57%	7,91%	15,21%	-6,04%	9,03%	212,72%	29-dez-2011	1.135.465.482,39
Alaska Black FIC FIA II - BDR Nível I IBOVESPA	26.648.868/0001-96	31/08/2022	Ações	1,58966950	-2,58%	7,91%	15,31%	-5,93%	9,72%	58,97%	3-jan-2017	284.721.826,34
Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM IMA-B	29.722.458/0001-36	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,42814690	-0,39%	3,65%	5,57%	4,64%	13,13%	42,81%	2-mai-2018	268.991.467,70
Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM IMA-B	34.081.155/0001-11	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,11722880	-0,60%	4,84%	4,46%	2,03%	11,72%	11,72%	5-mar-2020	26.323.433,24
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 70 IMA-B 5	32.761.323/0001-94	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,15216052	-0,45%	3,59%	5,26%	3,69%	12,53%	15,22%	31-out-2019	16.310.992,98
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100 IMA-B 5	32.757.743/0001-05	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,11458771	-0,68%	4,70%	4,28%	1,05%	12,87%	11,46%	1-nov-2019	58.422.840,26
Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM IMA-B	35.939.700/0001-20	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,16220970	-0,42%	3,53%	5,32%	3,83%	10,77%	16,22%	12-jun-2020	21.493.213,62
Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM IMA-B	35.939.857/0001-56	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,20279327	-0,64%	4,62%	4,33%	1,19%	9,98%	20,28%	1-jun-2020	28.659.482,75
Alaska Previdência 70 FIC FIM IMA-B	41.881.132/0001-57	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,08750180	-0,39%	3,67%	4,67%	-	-	8,75%	24-nov-2021	4.189.112,62
Alaska Previdência 100 FIC FIM IMA-B	37.313.900/0001-07	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	1,04546990	-0,68%	4,97%	4,30%	0,59%	-	4,55%	23-dez-2020	16.142.648,73
Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM IMA-B	39.254.233/0001-56	31/08/2022	Previdenciário Multiestratégia	0,94241480	-0,42%	3,62%	4,69%	2,12%	-	-5,76%	1-jun-2021	3.474.776,08
Alaska Range FIM CDI	13.001.211/0001-90	31/08/2022	Multiestratégia	2,38525819	-0,12%	2,88%	6,58%	6,39%	8,16%	81,32%	1-jul-2015	122.217.088,32

Atenciosamente,  
Alaska Asset Management.



Para maiores informações, consulte o Material Técnico dos fundos no site [www.alaska-asset.com.br/fundos](http://www.alaska-asset.com.br/fundos). As informações, materiais ou documentos aqui disponibilizados não caracterizam e não devem ser entendidos como recomendação de investimento, análise de valor mobiliário, material promocional, participação em qualquer estratégia de negócio, solicitação/oferta/esforço de venda ou distribuição de cotas dos fundos de investimento aqui indicados. Fundos de investimento mencionados neste documento podem utilizar estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do Fundo. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do fundo garantidor de créditos – FGC. A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada é líquida das taxas de administração e performance, mas não é líquida de impostos. Leia a lâmina de informações essenciais, se houver, e o regulamento dos fundos de investimento antes de aplicar seus recursos. As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo e não deve ser entendido como análise de valor mobiliário, material promocional, solicitação de compra ou venda, oferta ou recomendação de qualquer ativo financeiro ou investimento, sugestão de alocação ou adoção de estratégia de investimento por parte dos leitores. Alguns destes fundos tem menos de 12 (doze) meses, para avaliação da performance de fundos de investimento é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses.