

CARTA MENSAL – SETEMBRO/2022

A expectativa de continuidade do aperto monetário nos EUA e demais países desenvolvidos, juntamente com a desaceleração da atividade econômica global, impactaram em cheio o desempenho dos ativos de risco nos mercados internacionais. Bolsas e cestas de *commodities* caíram, em especial o petróleo. Já o dólar se fortaleceu contra seus principais pares e o ouro. No mercado local, o real performou próximo aos seus pares e o Ibovespa conseguiu fechar o mês em terreno positivo. Índices de inflação correntes em terreno negativo e o encerramento do ciclo de alta da Selic impactaram as taxas de juros, com maior intensidade nas longas. Com o fim do ciclo de alta, o mercado já começou a precificar cortes na taxa básica de juros no primeiro trimestre de 2023. Na esfera eleitoral, notícias foram fontes de ruídos no mercado doméstico.

SETEMBRO/2022	31/AGOSTO	Máximo	Mínimo	30/SETEMBRO	Oscilação
IBOVESPA	109.523	114.070	107.664	110.037	+0,47%
IBOVESPA (DOL)	21.128	22.293	19.937	20.319	-3,83%
DOLAR (PTAX)	5,18	5,41	5,12	5,41	+4,39%
Pré Jan/23	13,74	13,80	13,68	13,70	-4 bps
Pré Jan/25	11,97	12,08	11,49	11,59	-39 bps
Pré Jan/29	11,90	11,91	11,31	11,70	-20 bps

Fonte: Bloomberg

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

Fundos Alaska Black BDR: a carteira de ações apresentou desempenho positivo no mês, enquanto a posição comprada em bolsa local via opções contribuiu de forma negativa. 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, principalmente por conta da posição vendida em S&P500 via opções, estrutura que foi encerrada neste mês. 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.

SETEMBRO/2022	CNPJ	Renda Variável	Juros	Câmbio	Caixa	Custos*	Total
Alaska Institucional FIA	26.673.556/0001-32	+0,30%	-	-	+0,24%	-0,19%	+0,14%
Alaska Black FIC FIA - BDR Nível I	12.987.743/0001-86	-0,94%	+0,34%	-2,47%	+0,21%	-0,16%	-3,02%
Alaska Black FIC FIA II - BDR Nível I	26.648.868/0001-96	-0,93%	+0,34%	-2,46%	+0,21%	-0,17%	-3,01%
Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM	29.722.458/0001-36	+0,28%	-	-	+0,35%	-0,02%	+0,62%
Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM	34.081.155/0001-11	+0,37%	-	-	+0,02%	-0,11%	+0,28%
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 70	32.761.323/0001-94	+0,25%	-	-	+0,34%	-0,18%	+0,41%
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100	32.757.743/0001-05	+0,34%	-	-	+0,01%	-0,18%	+0,17%
Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM	35.939.700/0001-20	+0,28%	-	-	+0,34%	-0,11%	+0,52%
Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM	35.939.857/0001-56	+0,28%	-	-	+0,02%	-0,12%	+0,18%
Alaska Previdência 70 FIC FIM	41.881.132/0001-57	+0,33%	-	-	+0,35%	-0,12%	+0,55%
Alaska Previdência 100 FIC FIM	37.313.900/0001-07	+0,41%	-	-	+0,02%	-0,16%	+0,26%
Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM	39.254.233/0001-56	+0,33%	-	-	+0,34%	-0,14%	+0,54%
Alaska Range FIM	13.001.211/0001-90	+0,88%	+0,24%	-0,14%	+0,85%	-0,17%	+1,65%

*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				2,75438830	2,60%	0,14%	5,09%	7,91%	24,16%	175,44%	21-fev-2017	1.254.474.831,23
IBOVESPA	26.673.556/0001-32	30/09/2022	Ações	-	2,20%	0,47%	4,97%	-0,85%	16,31%	59,35%	-	-
Alaska Black FIC FIA - BDR Nível I*				2,40340680	4,43%	-3,02%	11,73%	6,89%	17,25%	203,28%	29-dez-2011	1.088.804.658,29
IPCA + 6%	12.987.743/0001-86	30/09/2022	Ações	-	0,01%	0,15%	9,25%	14,36%	33,29%	250,94%	-	-
Alaska Black FIC FIA II - BDR Nível I				1,54176000	4,43%	-3,01%	11,83%	7,02%	18,06%	54,18%	3-jan-2017	270.656.222,93
IBOVESPA	26.648.868/0001-96	30/09/2022	Ações	-	2,20%	0,47%	4,97%	-0,85%	16,31%	78,01%	-	-
Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM				1,43693670	1,78%	0,62%	6,22%	8,44%	18,82%	43,69%	2-mai-2018	267.823.809,18
IMA-B	29.722.458/0001-36	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	48,16%	-	-
Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM				1,12034480	2,54%	0,28%	4,75%	6,98%	19,83%	12,03%	5-mar-2020	28.669.527,13
IMA-B	34.081.155/0001-11	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	10,25%	-	-
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 70				1,15692494	1,80%	0,41%	5,69%	7,96%	18,60%	15,69%	31-out-2019	15.996.119,72
IMA-B 5	32.761.323/0001-94	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,12%	0,42%	7,07%	9,25%	15,75%	22,11%	-	-
Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100				1,11644983	2,60%	0,17%	4,45%	6,86%	21,28%	11,64%	1-nov-2019	58.140.582,65
IMA-B 5	32.757.743/0001-05	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,12%	0,42%	7,07%	9,25%	15,75%	22,02%	-	-
Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM				1,16821323	1,77%	0,52%	5,87%	8,16%	16,70%	16,82%	12-jun-2020	20.897.043,81
IMA-B	35.939.700/0001-20	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	13,77%	-	-
Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM				1,20492815	2,47%	0,18%	4,52%	6,97%	17,79%	20,49%	1-jun-2020	29.463.440,53
IMA-B	35.939.857/0001-56	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	15,78%	-	-
Alaska Previdência 70 FIC FIM				1,09353570	1,77%	0,55%	5,25%	-	-	9,35%	24-nov-2021	4.297.159,65
IMA-B	41.881.132/0001-57	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	7,10%	-	-
Alaska Previdência 100 FIC FIM				1,04817360	2,61%	0,26%	4,57%	6,74%	-	4,82%	23-dez-2020	16.519.697,54
IMA-B	37.313.900/0001-07	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	5,67%	-	-
Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM				0,94748220	1,77%	0,54%	5,25%	6,79%	-	-5,25%	1-jun-2021	3.715.619,41
IMA-B	39.254.233/0001-56	30/09/2022	Previdenciário Multiestratégia	-	0,56%	1,48%	6,12%	7,25%	12,30%	5,64%	-	-
Alaska Range FIM				2,42469080	1,12%	1,65%	8,34%	8,87%	12,80%	84,31%	1-jul-2015	124.400.038,78
CDI	13.001.211/0001-90	30/09/2022	Multiestratégia	-	0,05%	1,07%	8,89%	10,90%	14,21%	76,45%	-	-

Atenciosamente,
Alaska Asset Management.



Para maiores informações, consulte o Material Técnico dos fundos no site 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.