

## CARTA MENSAL – OUTUBRO/2022

Mesmo com a expectativa de continuidade do aperto monetário nos EUA, os ativos de risco globais tiveram bom desempenho em outubro. Bolsas e cestas de *commodities* subiram, enquanto o dólar cedeu contra seus principais pares. Bolsas dos mercados emergentes foram o destaque negativo, impactadas principalmente pelas perdas no mercado acionário chinês. Já no ambiente doméstico, os preços dos ativos de risco seguiram as notícias eleitorais ao longo do mês. O último pregão de outubro consolidou a performance positiva no mês dos ativos domésticos após o resultado das eleições. Ocorreu também mais uma reunião do COPOM, na qual foi decidida novamente a manutenção da Selic.

| OUTUBRO/2022   | 30/SETEMBRO | Máximo  | Mínimo  | 31/OUTUBRO | Oscilação |
|----------------|-------------|---------|---------|------------|-----------|
| IBOVESPA       | 110.037     | 119.929 | 112.072 | 116.037    | +5,45%    |
| IBOVESPA (DOL) | 20.319      | 23.228  | 20.955  | 22.402     | +10,25%   |
| DOLAR (SPOT)   | 5,42        | 5,38    | 5,16    | 5,18       | -4,35%    |
| Pré Jan/25     | 11,59       | 11,92   | 11,46   | 11,71      | +12 bps   |
| Pré Jan/27     | 11,54       | 11,81   | 11,25   | 11,49      | -4 bps    |
| Pré Jan/29     | 11,70       | 11,92   | 11,38   | 11,59      | -11 bps   |

Fonte: Bloomberg

**Alaska Institucional e Previdenciários:** as carteiras de ações apresentaram desempenhos positivos e superiores ao Ibovespa no mês. As posições no setor educação foram os destaques positivos, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor de mineração. Em outubro, as participações no setor financeiro 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:** 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, além das posições de arbitragem na curva em tamanho reduzido, os fundos carregam posição vendida em taxa na parte intermediária na curva, ambas estratégias apresentaram retornos negativos. 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 e na estratégia long & short entre a carteira de ações e o índice. Em juros, o fundo teve perdas 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.

| OUTUBRO/2022                                  | CNPJ               | Renda Variável | Juros  | Câmbio | Caixa  | Custos* | Total   |
|-----------------------------------------------|--------------------|----------------|--------|--------|--------|---------|---------|
| Alaska Institucional FIA                      | 26.673.556/0001-32 | +6,50%         | -      | -      | +0,01% | -0,17%  | +6,34%  |
| Alaska Black FIC FIA - BDR Nível I            | 12.987.743/0001-86 | +8,76%         | -0,33% | +4,17% | +0,21% | -0,23%  | +12,57% |
| Alaska Black FIC FIA II - BDR Nível I         | 26.648.868/0001-96 | +8,75%         | -0,33% | +4,17% | +0,21% | -0,18%  | +12,63% |
| Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM            | 29.722.458/0001-36 | +4,40%         | -      | -      | +0,33% | -0,58%  | +4,15%  |
| Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM           | 34.081.155/0001-11 | +6,35%         | -      | -      | +0,02% | -0,65%  | +5,71%  |
| Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 70  | 32.761.323/0001-94 | +4,42%         | -      | -      | +0,33% | -0,18%  | +4,57%  |
| Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100 | 32.757.743/0001-05 | +6,39%         | -      | -      | +0,01% | -0,18%  | +6,22%  |
| Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM  | 35.939.700/0001-20 | +4,42%         | -      | -      | +0,33% | -0,38%  | +4,37%  |
| Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM | 35.939.857/0001-56 | +6,39%         | -      | -      | +0,01% | -0,44%  | +5,97%  |
| Alaska Previdência 70 FIC FIM                 | 41.881.132/0001-57 | +4,51%         | -      | -      | +0,34% | -0,54%  | +4,31%  |
| Alaska Previdência 100 FIC FIM                | 37.313.900/0001-07 | +6,46%         | -      | -      | +0,02% | -0,19%  | +6,29%  |
| Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM               | 39.254.233/0001-56 | +4,56%         | -      | -      | +0,35% | -0,50%  | +4,42%  |
| Alaska Range FIM                              | 13.001.211/0001-90 | +1,77%         | -0,05% | +0,30% | +0,83% | -0,27%  | +2,59%  |

\*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<br>IBOVESPA                     | 26.673.556/0001-32 | 31/10/2022 | Ações                             | 2,92894120 | 0,54% | 6,34%  | 11,75% | 23,19%   | 33,03%   | 192,89%        | 21-fev-2017     | 1.312.366.221,84 |
| Alaska Black FIC FIA - BDR Nível I*<br>IPCA + 6%         | 12.987.743/0001-86 | 31/10/2022 | Ações                             | 2,70561890 | 3,67% | 12,57% | 25,78% | 39,45%   | 38,10%   | 241,42%        | 29-dez-2011     | 1.206.397.606,14 |
| Alaska Black FIC FIA II - BDR Nível I<br>IBOVESPA        | 26.648.868/0001-96 | 31/10/2022 | Ações                             | 1,73647360 | 3,70% | 12,63% | 25,95% | 39,67%   | 39,13%   | 73,65%         | 3-jan-2017      | 300.011.682,11   |
| Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM<br>IMA-B              | 29.722.458/0001-36 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,49660330 | 0,37% | 4,15%  | 10,63% | 18,35%   | 25,63%   | 49,66%         | 2-mai-2018      | 275.647.577,76   |
| Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM<br>IMA-B             | 34.081.155/0001-11 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,18435050 | 0,46% | 5,71%  | 10,73% | 21,02%   | 29,09%   | 18,44%         | 5-mar-2020      | 32.079.402,98    |
| Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 70<br>IMA-B 5  | 32.761.323/0001-94 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,20978585 | 0,31% | 4,57%  | 10,52% | 18,50%   | 25,68%   | 20,98%         | 31-out-2019     | 16.549.155,20    |
| Alaska Black Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100<br>IMA-B 5 | 32.757.743/0001-05 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,18591133 | 0,43% | 6,22%  | 10,95% | 22,13%   | 31,37%   | 18,59%         | 1-nov-2019      | 59.992.428,40    |
| Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM<br>IMA-B    | 35.939.700/0001-20 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,21925795 | 0,35% | 4,37%  | 10,49% | 18,49%   | 23,42%   | 21,93%         | 12-jun-2020     | 22.316.724,00    |
| Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM<br>IMA-B   | 35.939.857/0001-56 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,27682317 | 0,45% | 5,97%  | 10,75% | 21,93%   | 27,34%   | 27,68%         | 1-jun-2020      | 31.353.059,84    |
| Alaska Previdência 70 FIC FIM<br>IMA-B                   | 41.881.132/0001-57 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,14066050 | 0,41% | 4,31%  | 9,79%  | -        | -        | 14,07%         | 24-nov-2021     | 4.707.607,87     |
| Alaska Previdência 100 FIC FIM<br>IMA-B                  | 37.313.900/0001-07 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 1,11406340 | 0,51% | 6,29%  | 11,14% | 21,99%   | -        | 11,41%         | 23-dez-2020     | 17.651.809,27    |
| Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM<br>IMA-B                 | 39.254.233/0001-56 | 31/10/2022 | Previdenciário<br>Multiestratégia | 0,98933500 | 0,39% | 4,42%  | 9,90%  | 17,25%   | -        | -1,07%         | 1-jun-2021      | 4.140.298,90     |
| Alaska Range FIM<br>CDI                                  | 13.001.211/0001-90 | 31/10/2022 | Multiestratégia                   | 2,48746861 | 0,27% | 2,59%  | 11,14% | 13,71%   | 15,87%   | 89,08%         | 1-jul-2015      | 127.763.350,24   |

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.