

COMENTÁRIO MENSAL – MARÇO/2022

Alaska Black Institucional FIA – CNPJ 26.673.556/0001-32

O fundo Alaska Black Institucional FIA obteve um retorno de +6,91%, superior aos +6,06% do benchmark Ibovespa no mesmo período. O fundo teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor de óleo e gás reduziram. As duas posições mais relevantes, dos setores de mineração e de óleo e gás, possuem exposição próxima a 30% no portfólio.

Alaska Black FIC FIA – BDR Nível I – CNPJ 12.987.743/0001-86

O fundo Alaska Black FIC FIA – BDR Nível I obteve um retorno de +15,22%, superior aos +1,80% do benchmark IPCA + 6% a.a. e aos +6,06% do Ibovespa no mesmo período. A carteira de ações obteve um retorno de +7,10% e a posição comprada na bolsa local por meio de opções foi reduzida ao longo do mês, resultando numa contribuição de -1,30%. O fundo teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico. A posição vendida no dólar contra o real contribuiu em +8,63%. No mercado de juros, além das posições de arbitragem na curva em tamanho reduzido, os fundos abriram ao longo do mês posição vendida em taxa na parte intermediária na curva, e ainda carregam posições compradas em inclinação, resultando em um retorno de +0,92% no mês.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor petroquímico reduziram. As duas posições mais relevantes, dos setores de mineração e de óleo e gás, possuem exposição próxima a 30% no portfólio de renda variável. Além disso, o fundo possui estratégias de bolsa local, câmbio e juros, conforme detalhado anteriormente.

Alaska Black FIC FIA II – BDR Nível I – CNPJ 26.648.868/0001-96

O fundo Alaska Black FIC FIA II – BDR Nível I obteve um retorno de +15,29%, superior aos +6,06% do benchmark Ibovespa no mesmo período. A carteira de ações obteve um retorno de +7,10% e a posição comprada em bolsa local por meio de opções foi reduzida ao longo do mês, resultando numa contribuição de -1,30%. O fundo teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico. A posição vendida no dólar contra o real contribuiu em +8,63%. No mercado de juros, além das posições de arbitragem na curva em tamanho reduzido, os fundos abriram ao longo do mês posição vendida em taxa na parte intermediária na curva, e ainda carregam posições compradas em inclinação, resultando em um retorno de +0,92% no mês.

COMENTÁRIO MENSAL - MARÇO/2022

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor petroquímico reduziram. As duas posições mais relevantes, dos setores de mineração e de óleo e gás, possuem exposição próxima a 30% no portfólio de renda variável. Além disso, o fundo possui estratégias de bolsa local, câmbio e juros, conforme detalhado anteriormente.

Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM – CNPJ 29.722.458/0001-36

O fundo Alaska 70 Icatu Previdenciário FIM obteve um retorno de +4,70%, superior aos +3,07% do benchmark IMA-B. O fundo, que possui alocação próxima a 70% em ações e o restante em renda fixa, teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor petroquímico reduziram. O fundo segue posicionado aproximadamente 70% em ações, sendo as duas posições mais relevantes dos setores de mineração e de óleo e gás.

Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM – CNPJ 34.081.155/0001-11

O fundo Alaska 100 Icatu Previdenciário FIM obteve um retorno de +6,19%, superior aos +3,07% do benchmark IMA-B e aos +6,06% do Ibovespa. O fundo, que possui alocação próxima a 100% em ações, teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor petroquímico reduziram. O fundo segue posicionado aproximadamente 100% em ações, sendo as duas posições mais relevantes dos setores de mineração e de óleo e gás.

Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM – CNPJ 35.939.700/0001-20

O fundo Alaska Black 70 Advisory XP Seg Prev FIC FIM obteve um retorno de +4,94%, superior aos +3,07% do benchmark IMA-B. O fundo, que possui alocação próxima a 70% em ações e o restante em renda fixa, teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor de mineração reduziram. O fundo segue posicionado aproximadamente 70% em ações, sendo as duas posições mais relevantes dos setores de mineração e de óleo e gás.

COMENTÁRIO MENSAL – MARÇO/2022

Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM 100 – CNPJ 35.939.857/0001-56

O fundo Alaska Black 100 Advisory XP Seg Prev FIC FIM obteve um retorno de +6,75%, superior aos +3,07% do benchmark IMA-B e aos +6,06% do Ibovespa. O fundo, que possui alocação próxima a 100% em ações, teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor de mineração reduziram. O fundo segue posicionado aproximadamente 100% em ações, sendo as duas posições mais relevantes dos setores de mineração e de óleo e gás.

Alaska Previdência 100 FIC FIM – CNPJ 37.313.900/0001-07

O fundo Alaska Previdência 100 FIC FIM obteve um retorno de +6,98%, superior aos +3,07% do benchmark IMA-B e aos +6,06% do Ibovespa. O fundo, que possui alocação próxima a 100% em ações, teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor de mineração reduziram. O fundo segue posicionado aproximadamente 100% em ações, sendo as duas posições mais relevantes dos setores de mineração e de óleo e gás.

Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM – CNPJ 39.254.233/0001-56

O fundo Porto Seguro Alaska 70 Prev FIM obteve um retorno de +4,86%, superior aos +3,07% do benchmark IMA-B. O fundo, que possui alocação próxima a 70% em ações e o restante em renda fixa, teve como destaque positivo as posições em ações do setor de educação, enquanto do lado negativo o destaque foi o setor petroquímico.

Em março, as participações no setor de siderurgia aumentaram, enquanto as participações no setor de mineração reduziram. O fundo segue posicionado aproximadamente 70% em ações, sendo as duas posições mais relevantes dos setores de mineração e de óleo e gás.

Atenciosamente,
Alaska Asset Management.

