

Competência 28/12/2016 ▾ Exibir

Nome do Fundo ALASKA BLACK FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES II - BDR NÍVEL I

CNPJ do Fundo 26.648.868/0001-96

Tipo do Fundo FDOS DE INVESTIMENTO

Cód. CVM 270652

Administrador BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S/A DTVM

CNPJ do Administrador 59.281.253/0001-23

Formulário de Informações Complementares

Informações Complementares de código:
17902

CNPJ do fundo:
26.648.868/0001-96

Periodicidade mínima para divulgação da composição da carteira do fundo:

A composição da carteira do fundo será disponibilizada no mínimo mensalmente, até 10 (dez) dias após o encerramento do mês a que se referir, na sede da Administradora, bem como na página da CVM na rede mundial de computadores.

Local, Meio ou forma de divulgação

Tipo do meio de divulgação: eletrônico

Descrição do local de divulgação:

Praia de Botafogo, 501, 5 ° Andar - Rio de Janeiro - RJ - Brasil

Descrição da forma de Divulgação:

Este documento será atualizado no site da administradora, conforme última versão do regulamento.

Local, Meio ou forma de divulgação cotista

Tipo do meio de divulgação: Eletrônico

Descrição de texto enviada pela instituição:

O administrador do fundo disponibiliza os Serviço de Atendimento ao Cliente do BTG PACTUAL através do telefone 0800 772 2827

Descrição do local de divulgação

Página na rede mundial de computadores: www.btgpactual.com

Descrição da forma de divulgação

Para reclamações acesse o site do adm., o telefone 0800 722 004 ou e-mail ouvidoria@btgpactual.com.

Exposição, em ordem de relevância, dos fatores de riscos inerentes à composição da carteira do fundo

O fundo está sujeito aos fatores de risco listados abaixo, conforme a sua ordem de relevância: 1. Ações, 2. Taxa de Juros, 3. Cambial e 4. Investimento no Exterior.

Informações Políticas sobre o gestor

Informar se o gestor vota ou não em assembleias dos ativos que compõem a carteira: Sim

Descrição da política relativa ao exercício de direito do voto:

A Política de Voto do GESTOR destina-se a estabelecer a participação do GESTOR em todas as assembleias gerais dos emissores de títulos e valores mobiliários que confirmam direito de voto aos fundos de investimento sob sua gestão, nas hipóteses previstas em seus respectivos regulamentos e quando na pauta de suas convocações constarem as matérias relevantes obrigatórias descritas na referida Política de Voto. Ao votar nas assembleias representando os fundos de Investimento sob sua gestão, o GESTOR buscará votar favoravelmente às deliberações que, a seu ver, propiciem a valorização dos ativos financeiros que integrem a carteira do fundo de Investimento. A versão integral da Política de Voto do GESTOR encontra-se disponível no website do GESTOR no endereço: www.alaska-asset.com.br.

Descrição da tributação aplicável ao fundo e a seus cotistas, contemplando a política a ser adotada pelo administrador quanto ao tratamento tributário perseguido

Renda Variável - Indica que o Fundo de Investimento se enquadra na categoria de Renda Variável. Independentemente do prazo da aplicação: 15%.

Descrição da política de administração de risco, em especial dos métodos utilizados pelo administrador para gerenciar os riscos a que o fundo se encontra sujeito, inclusive risco de liquidez

O gerenciamento dos riscos a que o fundo está exposto é realizado através dos métodos abaixo descritos: Value at Risk - Uma das métricas adotadas para gerenciamento de risco do fundo é o Value at Risk (VaR). O cálculo do VaR é realizado utilizando-se o modelo de simulação histórica, de forma que nenhuma hipótese a respeito da distribuição estatística dos eventos é realizada. Além disso, são preservadas todas as correlações entre os ativos financeiros e as classes de ativos financeiros presentes no produto. O VaR é calculado em três níveis distintos: (i) o primeiro nível determina a exposição de cada ativo individualmente, mediante a simulação de todas as variáveis envolvidas na sua precificação; (ii) o segundo determina o risco por classe de ativos financeiros, apontando a exposição em cada um dos mercados nos quais o FUNDO atua levando em consideração a correlação entre cada um dos ativos financeiros; e (iii) o terceiro nível permite que seja mensurado o risco do FUNDO como um todo, determinando a exposição conjunta de toda carteira. (iv) Por fim, são analisados os resultados das simulações realizadas com os cenários aplicáveis. Deve ser ressaltado que os resultados apresentados pelo modelo de VAR possuem intervalos de confiança específicos (em geral, 95% e 99%), de forma que perdas maiores que aquelas cobertas pelo intervalo de confiança podem ocorrer e estão previstas no modelo. Análise de Cenários de Stress - O teste de stress é uma métrica complementar para estimar o comportamento da carteira do fundo em diferentes condições de mercado, baseada em cenários históricos ou em cenários hipotéticos (buscando, neste caso, avaliar os resultados potenciais do fundo em condições de mercado que não necessariamente tenham sido observadas no passado). Administração do Risco de Liquidez - O processo de administração do risco de

liquidez consiste no monitoramento dos ativos passíveis de liquidação financeira nas condições vigentes de mercado, no prazo estabelecido pelo Regulamento do fundo para o pagamento dos pedidos de resgate e cumprimento de todas as obrigações do mesmo. Este monitoramento leva também em consideração o passivo do fundo, analisando o perfil de concentração dos cotistas e seus históricos de aplicações/resgates. O monitoramento periódico não garante limites de perdas ou a eliminação dos riscos, sendo certo de que medidas de risco são quantitativas, baseadas em parâmetros estatísticos e estão sujeitas às condições de mercado.

Informações de Risco

Informação se existe ou não agência de classificação de rating

Não

CNPJ

Nome do Prestador

Classificação obtida pela agência de classificação de risco de crédito contratada

Padronização do disclaimer relativo a advertência da manutenção do serviço pela CVM

Detalhamento do administrador

Apresentação do administrador

A BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM, ou simplesmente "BTG PSF", possui autorização da CVM para prestar serviços de Administrador de Carteira de Valores Mobiliários (ato declaratório número 8695) e serviços de Escrituração de Quotas de Fundos de Investimentos (ato declaratório número 8696). A BTG Pactual Serviços Financeiros S.A. DTVM é uma empresa do grupo BTG Pactual, focada na prestação de serviço de administração fiduciária. A empresa foi criada em dezembro de 2002 e figura atualmente entre os dez maiores Administradores de Recursos de Terceiros do mercado brasileiro.

Apresentação do gestor de recursos

A ALASKA INVESTIMENTOS LTDA nasce a partir da junção da reconhecida visão empreendedora de Angela Freitas com o sólido e longo histórico de investimentos de Luiz Alves Paes de Barros. Iniciamos nossas atividades com cerca de R\$ 1 bilhão sob gestão. A ALASKA é resultado da combinação de esforços e talentos da equipe de gestão do Fundo de ações Black com a equipe da LAPB Gestão de Recursos, onde todos compartilham da mesma filosofia de trabalho. O time completo da ALASKA atua em conjunto desde julho/2015.

Detalhamento do Serviço Prestado

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Controlador de Ativo

Nome do Prestador:

BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S/A DTVM

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41: Controlador de Passivo

Nome do Prestador:

BTG PACTUAL SERVICOS FINANCEIROS S/A DTVM

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41:Custodiante**Nome do Prestador:**

BANCO BTG PACTUAL S A

Descrição do serviço prestado nos termos do artigo X, inciso 41:Distribuidor**Nome do Prestador:**

BANCO BTG PACTUAL S A

Detalhamento de Distribuição

Indicação se o distribuidor oferta para o público alvo do fundo, preponderantemente, fundos geridos por um único gestor ou por gestoras ligadas a um mesmo grupo econômico: Não

Descrição detalhada**Outras Informações****Informações sobre autorregulação anbima:**

Tipo ANBIMA: Ações Livre. Descrição: Fundos que não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em uma estratégia específica. A parcela em caixa pode ser investida em quaisquer ativos, desde que especificados em regulamento. Demais Fatores de Risco do Fundo: Crédito, Mercado, Risco de Concentração, Liquidez, Fatores de Macroeconômicos, Política Governamental, Regulatório, Dependência do Gestor, Risco de Mercado Externo e Derivativos. Para maiores informações, recomendamos a leitura do regulamento onde é possível observar a descrição completa dos riscos acima apresentados.

Demais informações relevantes ao investidor

A PRESENTE INSTITUIÇÃO ADERIU AO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO. ESTE FORMULÁRIO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS DISPOSIÇÕES DO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS PARA OS FUNDOS DE INVESTIMENTO, BEM COMO DAS NORMAS EMANADAS DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS. A AUTORIZAÇÃO PARA FUNCIONAMENTO E/OU VENDA DAS COTAS DESTA FUNDO NÃO IMPLICA, POR PARTE DA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS OU DA ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS, OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO FUNDO, DE SEU ADMINISTRADOR OU DAS DEMAIS INSTITUIÇÕES PRESTADORAS DE SERVIÇOS. ESTE FUNDO UTILIZA ESTRATÉGIAS QUE 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. O INVESTIMENTO DO FUNDO DE QUE TRATA ESTE FORMULÁRIO APRESENTA RISCOS PARA O INVESTIDOR. AINDA QUE O GESTOR DA CARTEIRA MANTENHA SISTEMA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS, NÃO HÁ GARANTIA DE COMPLETA ELIMINAÇÃO DA POSSIBILIDADE DE PERDAS PARA O FUNDO E PARA O INVESTIDOR. ESTE FUNDO NÃO CONTA COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO

GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU, AINDA, DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITOS - FGC. A RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. AS INFORMAÇÕES CONTIDAS NESSE FORMULÁRIO ESTÃO EM CONSONÂNCIA COM O REGULAMENTO DO FUNDO, MAS NÃO O SUBSTITUEM. É RECOMENDADA A LEITURA CUIDADOSA TANTO DESTE FORMULÁRIO QUANTO DO REGULAMENTO, COM ESPECIAL ATENÇÃO PARA AS CLÁUSULAS RELATIVAS AO OBJETIVO E À POLÍTICA DE INVESTIMENTO DO FUNDO, BEM COMO ÀS DISPOSIÇÕES DO FORMULÁRIO E DO REGULAMENTO QUE TRATAM DOS FATORES DE RISCO A QUE O FUNDO ESTÁ EXPOSTO. ESTE FUNDO PODE TER SUAS COTAS COMERCIALIZADAS POR VÁRIOS DISTRIBUIDORES, O QUE PODE GERAR DIFERENÇAS DE HORÁRIOS E VALORES MÍNIMOS PARA APLICAÇÃO OU RESGATE, E TELEFONES PARA ATENDIMENTO AO CLIENTE.