

## Informativo mensal aos investidores

### Carta Mensal

Em agosto a bolsa brasileira novamente teve um desempenho fraco em relação às bolsas mundiais. Nos EUA, o índice S&P 500 superou o recorde do final de julho, com alta de +2,90% no mês. Aqui no Brasil, o índice bovespa caiu -2,48%, ainda pressionado por ruídos políticos e pelo aperto das condições financeiras que ocorre na esteira da alta de juros sendo executada pelo banco central brasileiro. Como bem explicado pelo Tarik na última [carta macro](#), acreditamos que houve certo exagero na alta recente dos juros no Brasil, considerando que boa parte das pressões inflacionárias recentes reflete gargalos de oferta, não relacionados ao custo do dinheiro e sim às medidas tomadas em relação à pandemia e ao cenário hídrico. Acreditamos que o cenário para juros deveria melhorar ao longo de 2022, o que nos motiva a manter a alocação dos fundos.

Seguimos comprados em bolsa em todos os fundos. Nosso fundo macro (Tracker) mantém posição vendida na curva de juros e no dólar.

Assim como para o ibovespa, o mês de agosto foi novamente desafiador para os fundos da casa. Tivemos queda de -12,7%, -5,80%, -6,1% e -4,2% no Versa, Fit, Tracker e Charger, respectivamente. Os destaques negativos do mês foram as ações da Lojas Marisa (-14%), Via-Varejo (-18,6%), Guararapes (-12,5%), Vale (-9,3%) e General Motors (-13,8%). Do lado positivo, tivemos altas na Braskem (+14,3%), Ternium (+11,8%), Vivara (+6,4%) e Sabesp (+1,9%).

**Tabela 1: Comparativo de cota e performance mensal**

	30-jul-21	31-ago-21	Variação
Versa	18,10	15,80	-12,7%
Fit	1,98	1,86	-5,8%
Tracker	1,43	1,34	-6,1%
Charger	1,78	1,70	-4,2%
Genesis	0,96	0,91	-5,8%
CDI	-	-	0,4%
Ibovespa	121.801	118.781	-2,5%
S&P500	4.395,26	4.522,68	2,9%

Finalizamos o mês com uma novidade. A Versa entrou no 3º IPO da sua história, o IPO do Grupo Vittia. Investimos na Vittia por acreditar que o preço do IPO não refletiu adequadamente o potencial de crescimento e rentabilidade da Cia. Mais detalhes aqui:

[Por que investimos no Grupo Vittia?](#)

## Equipe Versa

Tabela 2: Exposição e performance mensal dos fundos

	Exposição média					P&L				
	VERSA	FIT	CHARGER	TRACKER	GENESIS	VERSA	FIT	CHARGER	TRACKER	GENESIS
Long	272,4%	133,3%	99,4%	34,2%	-	-11,3%	-5,7%	-4,1%	-1,8%	-
Short	-178,9%	-86,6%	-	-18,8%	-	5,0%	2,6%	-	0,5%	-
Opção Dólar	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Opção de Bovespa	58,3%	26,7%	-	-	-	-2,7%	-1,2%	-	-	-
Opção de Ação	26,6%	11,7%	-	-0,0%	-	-4,0%	-1,8%	-	0,9%	-
Hedge	-19,5%	-10,7%	-6,3%	-2,5%	-	0,1%	0,0%	0,0%	0,0%	-
RF-Stocks	-	-	-	52,6%	175,7%	-	-	-	-0,6%	-5,1%
Câmbio	-	-	-	-80,1%	-	-	-	-	0,4%	-
Pré	-	3,1%	-	588,7%	-	-	0,1%	-	-5,9%	-
FII	-	-	-	-	20,9%	-	-	-	-	-0,5%
Caixa e Outros	0,6%	51,8%	0,8%	39,2%	-	0,2%	0,3%	-0,2%	0,3%	-0,2%
<b>Total</b>	-	-	-	-	-	<b>-12,7%</b>	<b>-5,8%</b>	<b>-4,2%</b>	<b>-6,1%</b>	<b>-5,8%</b>

Tabela 3: Destaques positivos no mês

	Δ Ativo	Contribuição (%)	
		Versa	Fit
Índice Bovespa	-2,5%	2,3%	1,4%
Braskem	14,3%	1,2%	0,7%
Ternium	10,9%	1,0%	0,5%
Vivara	6,4%	0,7%	0,4%
Sabesp	1,9%	0,3%	0,2%

Tabela 4: Destaques negativos no mês

	Δ Ativo	Contribuição (%)	
		Versa	Fit
Via Varejo	-18,6%	-2,8%	-1,3%
Lojas Marisa	-14,0%	-2,6%	-1,4%
Vale	-9,3%	-2,1%	-1,3%
Guararapes	-12,5%	-2,1%	-1,1%
General Motors	-14,9%	-1,3%	-0,8%

# Disclaimer

As opiniões, análises e informações contidas nesse documento não constituem recomendação de investimento, nem tampouco material de oferta para subscrição, compra ou venda de títulos ou valores mobiliários, instrumentos financeiros, cotas em fundos de investimento ou qualquer produto ou serviço de investimentos. Declarações contidas neste artigo relativas às perspectivas dos negócios, projeções de resultados operacionais e financeiros, bem como referências ao potencial de crescimento das companhias citadas, constituem meras previsões, baseadas nas expectativas do analista responsável em relação ao futuro. Essas expectativas são altamente dependentes de fatores incertos, como o comportamento do mercado, da situação econômica do Brasil, da indústria e dos mercados internacionais. Portanto, cada declaração aqui escrita está sujeita a mudanças, e não deve ser utilizada como insumo para qualquer estratégia de investimento pessoal ou institucional. A Versa Gestora de Recursos Ltda., seus sócios e colaboradores, por meio dos fundos de investimentos da casa, podem ou não estarem posicionados em títulos e valores mobiliários de emissores aqui mencionados, de forma que eventualmente influencie nas opiniões e análises aqui presentes.



## **Versa Gestora de Recursos LTDA**

CNPJ 28.728.697/0001-30

Rua Joaquim Floriano, nº 733, conjunto 5A

CEP: 04534-012 São Paulo-SP Brasil

Tel.: (11) 3078-1914 // Tel. R.I.: (11) 3280-7975

contato@versaasset.com.br

[www.versa-asset.com.br](http://www.versa-asset.com.br)

[www.fundoversa.com.br](http://www.fundoversa.com.br)



## Informativo Mensal dos fundos

*Clique no nome para acessar o informativo*

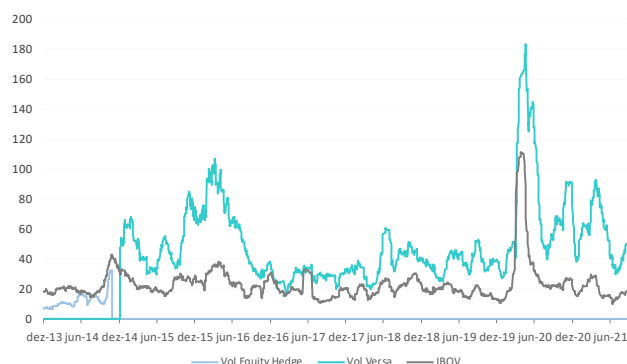
- [Versa Long Biased](#)
- [Versa FIT](#)
- [Versa Charger](#)
- [Versa Tracker](#)
- [Versa Genesis](#)

# Versa Long Biased FIM

## Risco vs. Retorno

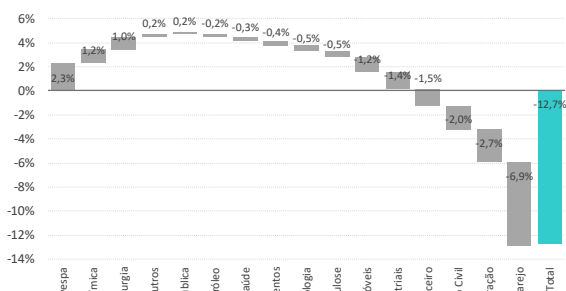
Parâmetro	
Valor da Cota	15,7962226
Patrimônio Líquido (em R\$MM)	366,06M
Patrimônio Líquido Médio de 12 meses (em R\$MM)	339,72M
Retorno Fundo (12 meses)	5,1%
Risco	
Volatilidade Fundo 12 meses (a.a)	49,3%
Volatilidade Ibovespa 12 meses (a.a)	20,6%
Exposição Net	195,2%
Exposição Gross	445,3%
Exposição Gross (RV)	328,8%
Exposição Net (RV)	195,2%
Exposição Net (FX)	-19,0%
Dados Históricos (desde o início)	
Retorno Fundo	1479,6%
Retorno CDI	89,0%
Retorno Ibovespa	115,7%
% de Meses Positivos	17,6%

## Volatilidade Histórica (% a.a)



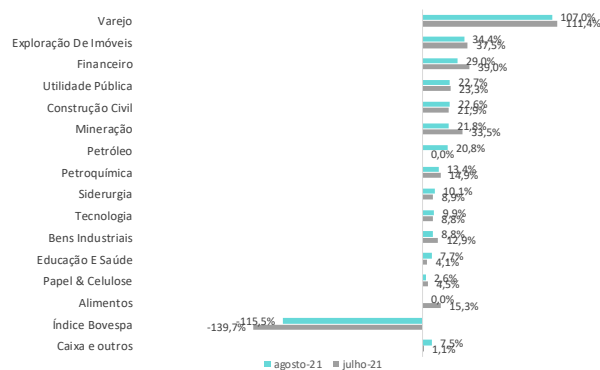
## Performance mensal

Data base: 31-08-2021



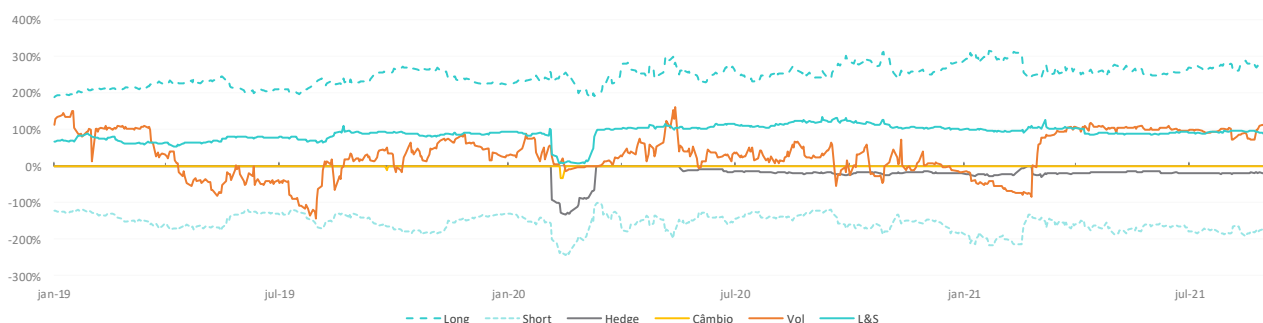
## Exposição (%)

Data base: 31-08-2021 / 30-07-2021



Caixa e outros: inclui contas a pagar/receber e custos como taxa de administração e performance

## Exposição Histórica por book



## Retorno Histórico

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO
2021	Fundo	-21,9%	-30,0%	13,9%	35,7%	23,6%	9,9%	-8,8%	-12,7%	-	-	-	-	-8,7%
	IBOV	-3,3%	-4,4%	6,0%	1,9%	6,2%	0,5%	-3,9%	-2,5%	-	-	-	-	-0,2%
	CDI	0,1%	0,1%	0,2%	0,2%	0,3%	0,3%	0,4%	0,4%	-	-	-	-	2,1%
2020	Fundo	-16,2%	18,5%	-15,3%	22,1%	14,8%	19,8%	15,3%	-1,9%	-19,7%	-9,8%	58,8%	0,0%	83,8%
	IBOV	-1,6%	-8,4%	-29,9%	10,3%	8,6%	8,8%	8,3%	-3,4%	-4,8%	-0,7%	15,9%	9,3%	2,9%
	CDI	0,4%	0,3%	0,3%	0,3%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,1%	0,2%	2,8%
2019	Fundo	21,5%	-4,1%	-0,5%	-11,0%	-4,5%	15,5%	3,4%	-12,1%	-3,0%	3,1%	6,0%	38,3%	51,6%
	IBOV	10,8%	-1,9%	-0,2%	1,0%	0,7%	4,1%	0,8%	-0,7%	3,6%	2,4%	0,9%	6,8%	31,6%
	CDI	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,6%	0,5%	0,5%	0,5%	0,4%	0,4%	6,0%
2018	Fundo	32,2%	9,5%	-2,1%	0,6%	-11,0%	-11,4%	11,3%	-19,4%	-18,0%	31,1%	11,4%	2,3%	23,5%
	IBOV	11,1%	0,5%	0,0%	0,9%	-10,9%	-5,2%	8,9%	-3,2%	3,5%	10,2%	2,4%	-1,8%	15,0%
	CDI	0,6%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,6%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	6,4%

# Versa Long Biased FIM



## Informações Gerais

Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVMS/A
Custodiante	BNY Mellon Banco S/A
Auditoria	KPMG Auditores Independentes S/A
CNPJ do fundo	18.832.847/0001-06
Início do Fundo	28/10/2013
Categoria ANBIMA	Multimercado Estratégia Long & Short Direcional
Categoria CVM	Multimercado
Código ANBIMA	350729
Código Bloomberg	GTIEHDG:8Z

Taxa de Administração	2,00% a.a.
Taxa de Performance	20% sobre o que exceder o CDI, semestralmente com marca d'água
Tributação	Ações (alíquota: 15%)
Investimento Inicial	R\$500.000
Saldo Mínimo	R\$5.000
Movimentação Mínima	R\$1.000
Horário Limite	14:00
Aplicação	Conversão das cotas em D+1 (úteis)
Resgate	Conversão da cota em D+18 (úteis) e liquidação em D+20 (úteis).

## Disclaimer

Acesse outros documentos relevantes: <https://www.fundoversa.com.br/infos-regulatorias/>

Fonte de dados do material: VERSA Gestora de Recursos LTDA

Material de divulgação do fundo - Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela VERSA Gestora de Recursos LTDA. ("VERSA ASSET"), e não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto na Instrução CVM 409 ou no Código de Auto-Regulação da ANBID. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento social do Fundo de investimento pelo investidor ao aplicar os seus recursos. A VERSA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base neste material.

Objetivo de investimento: O objetivo do fundo é buscar retornos superiores ao CDI no longo prazo através da gestão ativa de uma carteira de ações, com alavancagem e posições vendidas à descoberto, utilizando também derivativos financeiros. Público Alvo: O fundo tem como público alvo investidores em geral que buscam performance diferenciada e entendam e estejam dispostos a assumir riscos inerentes a política de investimentos do fundo, que possui alavancagem.

A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. A data de conversão de cotas é diversa da data de resgate e a data de pagamento do resgate é diversa da data do pedido de resgate. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Os fundos geridos pela VERSA utilizam 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. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

Tipo Anbima: Long&Short Direcional - Fundos que fazem operações de ativos e derivativos ligados ao mercado de renda variável, montando posições compradas e vendidas. O resultado deve ser proveniente, preponderantemente, da diferença entre essas posições. Os recursos remanescentes em caixa devem estar investidos em cotas de fundos Renda Fixa – Duração Baixa – Grau de Investimento ou em ativos permitidos a estes desde que preservadas as regras que determinam a composição da carteira do tipo ANBIMA.

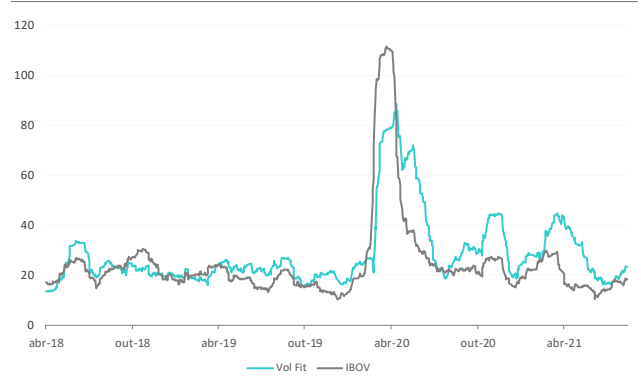
Em atendimento à Instrução CVM nº 465, desde 02/05/2008, os fundos de renda variável deixaram de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações e passou a fazê-lo com base na cotação de fechamento. Assim comparações de rentabilidade devem utilizar, para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média dos índices de ações e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

# Versa Fit Long Biased FIM

## Risco vs. Retorno

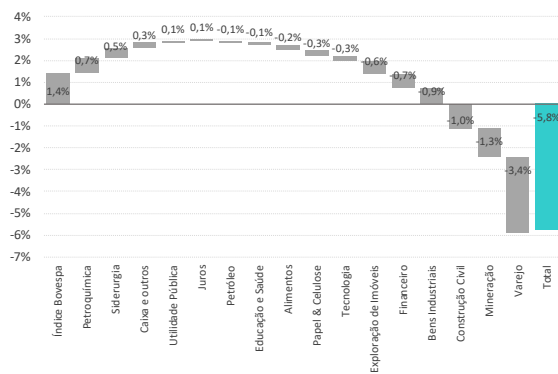
Parâmetro	
Valor da Cota	1,86107888
Patrimônio Líquido (em R\$MM)	165,33M
Patrimônio Líquido Médio de 12 meses (em R\$MM)	114,07M
Retorno Fundo (12 meses)	16,7%
Risco	
Volatilidade Fundo 12 meses (a.a)	23,3%
Volatilidade Ibovespa 12 meses (a.a)	20,6%
Exposição Net	94,8%
Exposição Gross	213,9%
Exposição Gross (RV)	157,2%
Exposição Net (RV)	94,8%
Exposição Net (FX)	-10,4%
Dados Históricos (desde o início)	
Retorno Fundo	86,1%
Retorno CDI	16,9%
Retorno Ibovespa	38,7%
% de Meses Positivos	7,4%

## Volatilidade Histórica (% a.a)



## Performance mensal

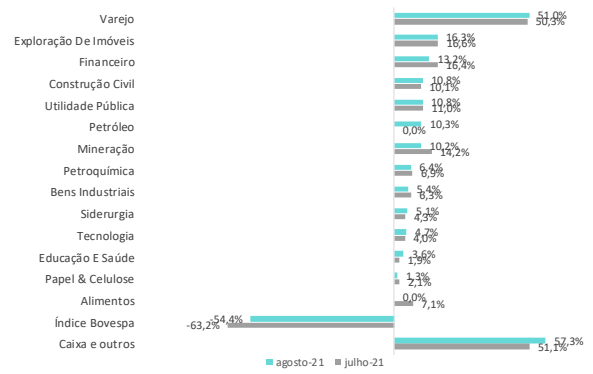
Data base: 31-08-2021



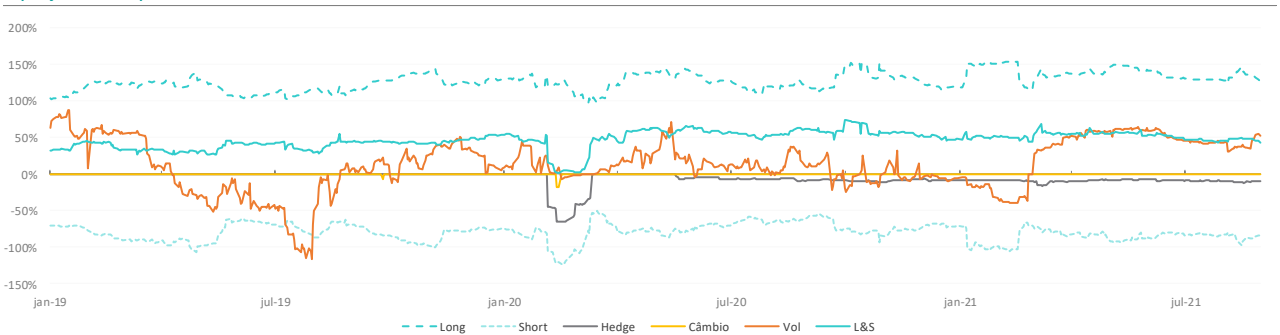
Caixa e outros: inclui contas a pagar/receber e custos como taxa de administração e performance

## Exposição (%)

Data base: 31-08-2021 / 30-07-2021



## Exposição Histórica por book



## Retorno Histórico

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO
2021	Fundo	-8,9%	-15,2%	7,4%	18,0%	12,0%	5,7%	-3,8%	-5,8%	-	-	-	-	4,9%
	IBOV	-3,3%	-4,4%	6,0%	1,9%	6,2%	0,5%	-3,9%	-2,5%	-	-	-	-	-0,2%
	CDI	0,1%	0,1%	0,2%	0,2%	0,3%	0,3%	0,4%	0,4%	-	-	-	-	2,1%
2020	Fundo	-9,1%	9,3%	-5,2%	11,3%	7,5%	11,8%	7,1%	-0,8%	-8,9%	-3,9%	26,1%	0,7%	48,9%
	IBOV	-1,6%	-8,4%	-29,9%	10,3%	8,6%	8,8%	8,3%	-3,4%	-4,8%	-0,7%	15,9%	9,3%	2,9%
	CDI	0,4%	0,3%	0,3%	0,3%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,1%	0,2%	2,8%
2019	Fundo	12,4%	-2,6%	0,1%	-6,8%	-1,6%	8,4%	1,3%	-7,8%	-1,6%	1,8%	2,9%	21,9%	27,8%
	IBOV	10,8%	-1,9%	-0,2%	1,0%	0,7%	4,1%	0,8%	-0,7%	3,6%	2,4%	0,9%	6,8%	31,6%
	CDI	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,6%	0,5%	0,5%	0,5%	0,4%	0,4%	6,0%
2018	Fundo	-	-	-0,8%	0,3%	-6,5%	-5,9%	6,8%	-10,9%	-9,2%	14,8%	5,9%	1,3%	-6,8%
	IBOV	-	-	-0,3%	0,9%	-10,9%	-5,2%	8,9%	-3,2%	3,5%	10,2%	2,4%	-1,8%	2,6%
	CDI	-	-	0,4%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,6%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	#VALOR!

# Versa Fit Long Biased FIM



## Informações Gerais

Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVMS/A
Custodiante	BNY Mellon Banco S/A
Auditoria	KPMG Auditores Independentes S/A
CNPJ do fundo	29.574.952/0001-09
Início do Fundo	06/03/2018
Categoria ANBIMA	Multimercado Estratégia Long & Short Direcional
Categoria CVM	Multimercado
Código ANBIMA	469173
Código Bloomberg	VRSFITL: BZ

Taxa de Administração	2,00% a.a.
Taxa de Performance	20% sobre o que exceder o CDI, semestralmente com marca d'água
Tributação	Ações (alíquota: 15%)
Investimento Inicial	R\$500
Saldo Mínimo	R\$500
Movimentação Mínima	R\$100
Horário Limite	14:00
Aplicação	Conversão das cotas em D+1 (úteis)
Resgate	Conversão da cota em D+9 (úteis) e liquidação em D+10 (úteis).

## Disclaimer

Accesse outros documentos relevantes: <https://www.fundoversa.com.br/infos-regulatorias/>

Fonte de dados do material: VERSA Gestora de Recursos LTDA

Material de divulgação do fundo - Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela VERSA Gestora de Recursos LTDA. ("VERSA ASSET"), e não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto na Instrução CVM 409 ou no Código de Auto-Regulação da ANBID. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento social do Fundo de investimento pelo investidor ao aplicar os seus recursos. A VERSA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base neste material.

Objetivo de investimento: O objetivo do fundo é buscar retornos superiores ao CDI no longo prazo através da gestão ativa de uma carteira de ações, com alavancagem e posições vendidas à descoberto, utilizando também derivativos financeiros. Público Alvo: O fundo tem como público alvo investidores em geral que buscam performance diferenciada e entendam e estejam dispostos a assumir riscos inerentes a política de investimentos do fundo, que possui alavancagem.

A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. A data de conversão de cotas é diversa da data de resgate e a data de pagamento do resgate é diversa da data do pedido de resgate. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Os fundos geridos pela VERSA utilizam 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. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

Tipo Anbima: Long&Short Direcional - Fundos que fazem operações de ativos e derivativos ligados ao mercado de renda variável, montando posições compradas e vendidas. O resultado deve ser proveniente, preponderantemente, da diferença entre essas posições. Os recursos remanescentes em caixa devem estar investidos em cotas de fundos Renda Fixa – Duração Baixa – Grau de Investimento ou em ativos permitidos a estes desde que preservadas as regras que determinam a composição da carteira do tipo ANBIMA.

Em atendimento à Instrução CVM nº 465, desde 02/05/2008, os fundos de renda variável deixaram de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações e passou a fazê-lo com base na cotação de fechamento. Assim comparações de rentabilidade devem utilizar, para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média dos índices de ações e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.



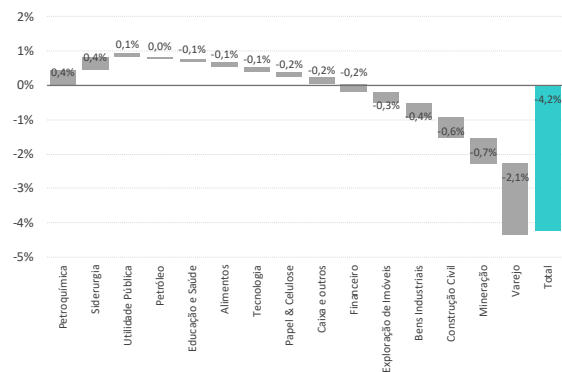
# Versa Charger BDR Nível I FIA

## Risco vs. Retorno

Parâmetro	
Valor da Cota	1,69990918
Patrimônio Líquido (em R\$MM)	35,30M
Patrimônio Líquido Médio de 12 meses (em R\$MM)	26,70M
Retorno Fundo (12 meses)	19,3%
Risco	
Volatilidade Fundo 12 meses (a.a)	9,3%
Volatilidade Ibovespa 12 meses (a.a)	20,6%
Exposição Net	99,6%
Exposição Gross	105,9%
Exposição Gross (RV)	99,6%
Exposição Net (RV)	99,6%
Exposição Net (FX)	-6,3%
Dados Históricos (desde o início)	
Retorno Fundo	70,0%
Retorno CDI	10,9%
Retorno Ibovespa	25,7%
% de Meses Positivos	7,1%

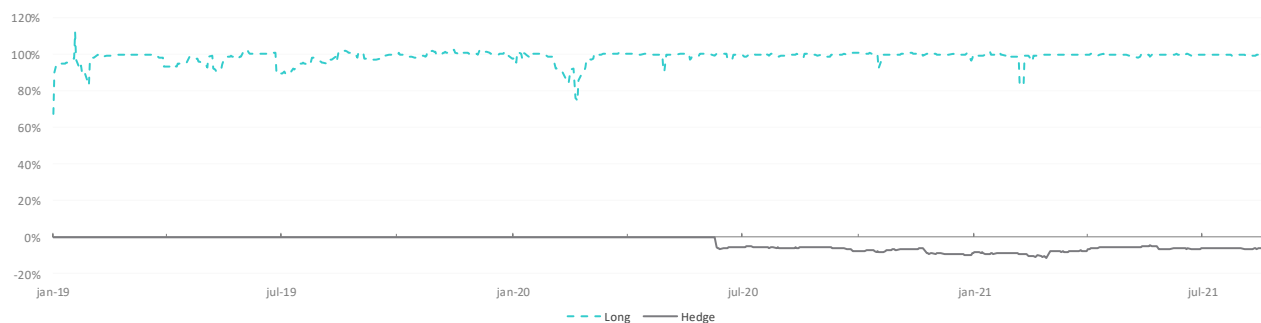
## Performance mensal

Data base: 31-08-2021



Caixa e outros: inclui contas a pagar/receber e custos como taxa de administração e performance

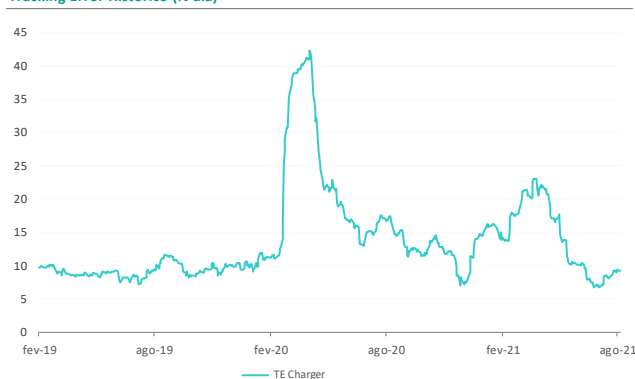
## Exposição Histórica por book



## Retorno Histórico

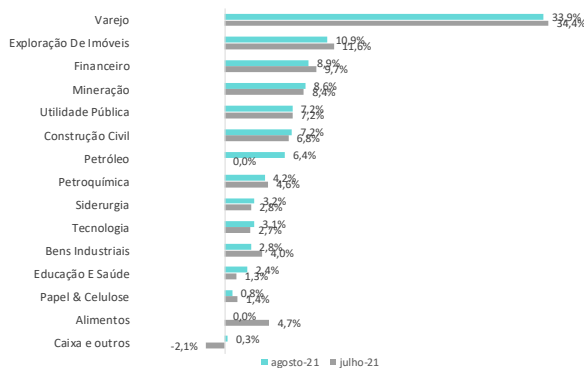
Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO
2021	Fundo	-4,4%	-9,4%	7,5%	11,7%	9,5%	3,6%	-4,2%	-4,2%	-	-	-	-	8,2%
	IBOV	-3,3%	-4,4%	6,0%	1,9%	6,2%	0,5%	-3,9%	-2,5%	-	-	-	-	-0,2%
	(+/-)	-1,1%	-5,0%	1,5%	9,8%	3,4%	3,1%	-0,3%	-1,8%	-	-	-	-	8,4%
2020	Fundo	-2,7%	-7,8%	-32,5%	13,7%	9,2%	12,2%	8,6%	1,2%	-5,2%	-1,5%	16,2%	1,6%	2,1%
	IBOV	-1,6%	-8,4%	-29,9%	10,3%	8,6%	8,8%	8,3%	-3,4%	-4,8%	-0,7%	15,9%	9,3%	2,9%
	(+/-)	-1,1%	0,6%	-2,6%	3,4%	0,6%	3,4%	0,3%	4,6%	-0,4%	-0,8%	0,3%	-7,7%	-0,8%
2019	Fundo	4,5%	-1,4%	0,5%	1,2%	1,1%	6,5%	6,6%	2,4%	0,6%	1,0%	5,5%	16,6%	53,9%
	IBOV	3,1%	-1,9%	-0,2%	1,0%	0,7%	4,1%	0,8%	-0,7%	3,6%	2,4%	0,9%	6,8%	22,4%
	(+/-)	1,4%	0,5%	0,7%	0,2%	0,4%	2,5%	5,8%	3,0%	-3,0%	-1,4%	4,5%	9,8%	31,4%
2018	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	IBOV	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(+/-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## Tracking Error Histórico (% a.a)



## Exposição (%)

Data base: 31-08-2021 / 30-07-2021



# Versa Charger BDR Nível I FIA



## Informações Gerais

Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM/S/A
Custodiante	BNY Mellon Banco S/A
Auditoria	KPMG Auditores Independentes S/A
CNPJ do fundo	31.132.367/0001-92
Início do Fundo	14/01/2019
Categoria ANBIMA	Ações Livre
Categoria CVM	Fundo de Ações
Código ANBIMA	484687
Código Bloomberg	VERSCHR: BZ

Taxa de Administração	2,00% a.a.
Taxa de Performance	20% sobre o que exceder o IBOVESPA, semestralmente com marca d'água
Tributação	Ações (alíquota: 15%)
Investimento Inicial	R\$500
Saldo Mínimo	R\$500
Movimentação Mínima	R\$100
Horário Limite	14:00
Aplicação	Conversão das cotas em D+1 (úteis)
Resgate	Conversão da cota em D+12 (úteis) e liquidação em D+14 (úteis).

## Disclaimer

Acesse outros documentos relevantes: <https://www.fundoversa.com.br/infos-regulatorias/>

Fonte de dados do material: VERSA Gestora de Recursos LTDA

Material de divulgação do fundo - Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela VERSA Gestora de Recursos LTDA. ("VERSA ASSET"), e não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto na Instrução CVM 409 ou no Código de Auto-Regulação da ANBID. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento social do Fundo de investimento pelo investidor ao aplicar os seus recursos. A VERSA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base neste material.

Objetivo de investimento: O objetivo do fundo é buscar retornos superiores ao IBOVESPA no longo prazo através da gestão ativa de uma carteira de ações, sem alavancagem, sem posições vendidas à descoberto e sem utilizar derivativos financeiros. Público Alvo: O fundo tem como público alvo investidores em geral que buscam performance diferenciada e entendam e estejam dispostos a assumir riscos inerentes a política de investimentos do fundo. A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. A data de conversão de cotas é diversa da data de resgate e a data de pagamento do resgate é diversa da data do pedido de resgate. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Os fundos geridos pela VERSA utilizam 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. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

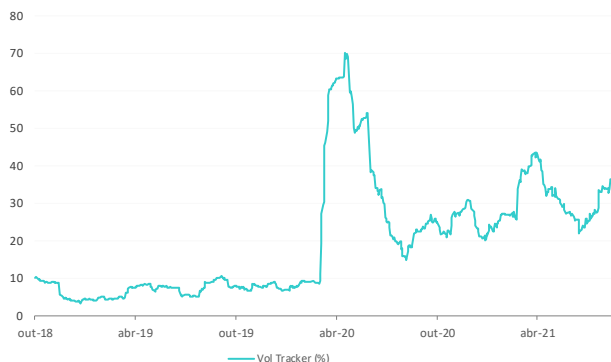
Tipo Anbima: Ações Livre - Fundos que não possuem obrigatoriamente o compromisso de concentração em uma estratégia específica. A parcela em caixa pode ser investida em quaisquer ativos, desde que especificados em regulamento.

Em atendimento à Instrução CVM nº 465, desde 02/05/2008, os fundos de renda variável deixaram de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações e passou a fazê-lo com base na cotação de fechamento. Assim comparações de rentabilidade devem utilizar, para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média dos índices de ações e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

## Risco vs. Retorno

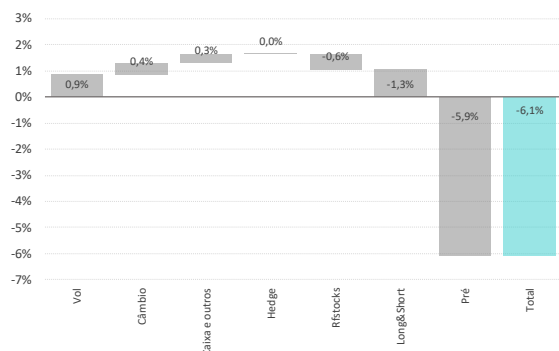
Parâmetro	
Valor da Cota	1,34309011
Patrimônio Líquido (em R\$MM)	52,31M
Patrimônio Líquido Médio de 12 meses (em R\$MM)	55,93M
Retorno Fundo (12 meses)	-9,4%
Risco	
Volatilidade Fundo 12 meses (a.a)	37,8%
Volatilidade Ibovespa 12 meses (a.a)	20,6%
Exposição Net	665,1%
Exposição Gross	708,0%
Exposição Gross (RV)	105,2%
Exposição Net (RV)	64,8%
Exposição Net (FX)	-82,4%
Dados Históricos (desde o início)	
Retorno Fundo	34,3%
Retorno CDI	13,5%
Retorno Ibovespa	52,4%
% de Meses Positivos	6,7%

## Volatilidade Histórica (% a.a)



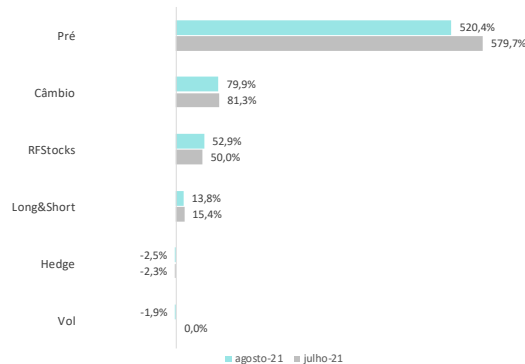
## Performance mensal

Data base: 31-08-2021

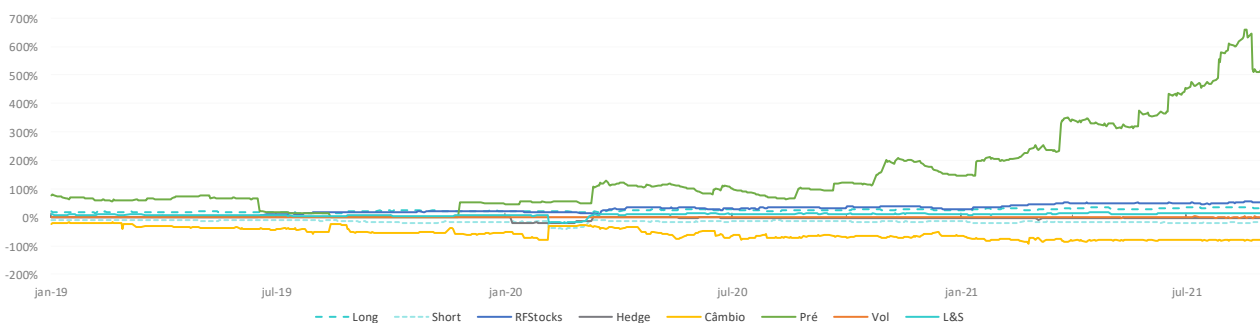


## Exposição (%)

Data base: 31-08-2021 / 30-07-2021



## Exposição Histórica por book



## Retorno Histórico

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO
2021	Fundo	-9,3%	-12,0%	1,6%	8,4%	7,8%	0,1%	-8,7%	-6,1%	-	-	-	-	-18,7%
	CDI	0,1%	0,1%	0,2%	0,2%	0,3%	0,3%	0,4%	0,4%	-	-	-	-	2,1%
	%CDI	-	-	788,6%	4026,8%	2898,0%	28,2%	-	-	-	-	-	-	-
2020	Fundo	-3,4%	1,9%	-2,0%	4,2%	7,3%	4,3%	6,9%	-6,0%	-6,0%	-3,7%	13,6%	8,4%	25,9%
	CDI	0,4%	0,3%	0,3%	0,3%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,2%	0,1%	0,2%	2,8%
	%CDI	-	639,1%	-	1461,5%	3102,3%	2031,0%	3532,2%	-	-	-	9104,9%	5078,9%	939,4%
2019	Fundo	3,8%	-0,2%	-0,2%	-0,1%	1,3%	3,4%	1,9%	-2,9%	-0,1%	1,6%	-0,4%	8,4%	17,2%
	CDI	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,6%	0,5%	0,5%	0,5%	0,4%	0,4%	6,0%
	%CDI	696,4%	-	-	-	232,2%	720,5%	340,3%	-	-	330,8%	-	2244,7%	288,4%
2018	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-0,3%	1,5%	7,0%	1,8%	1,7%	12,0%
	CDI	-	-	-	-	-	-	-	0,1%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	2,1%
	%CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	318,9%	1281,1%	369,0%	336,2%	566,7%

## Informações Gerais

Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVMS/A
Custodiante	BNY Mellon Banco S/A
Auditoria	KPMG Auditores Independentes S/A
CNPJ do fundo	30.887.013/0001-95
Início do Fundo	27/08/2018
Categoria ANBIMA	Multimercado Macro
Categoria CVM	Multimercado
Código ANBIMA	473677
Código Bloomberg	VERSTRK: BZ

Taxa de Administração	1,00% a.a.
Taxa de Performance	15% sobre o que exceder o CDI, semestralmente com marca d'água
Tributação	Longo prazo (alíquota: Em função do prazo (ver disclaimer))
Investimento Inicial	R\$500
Saldo Mínimo	R\$500
Movimentação Mínima	R\$100
Horário Limite	14:00
Aplicação	Conversão das cotas em D+0
Resgate	Conversão da cota em D+0 e liquidação em D+1 (úteis).

## Disclaimer

Acesse outros documentos relevantes: <https://www.fundoversa.com.br/infos-regulatorias/>

Fonte de dados do material: VERSA Gestora de Recursos LTDA

Material de divulgação do fundo - Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela VERSA Gestora de Recursos LTDA. ("VERSA ASSET"), e não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto na Instrução CVM 409 ou no Código de Auto-Regulação da ANBID. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento social do Fundo de investimento pelo investidor ao aplicar os seus recursos. A VERSA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base neste material.

Objetivo de investimento: O objetivo do fundo é buscar retornos superiores ao CDI no longo prazo através da gestão ativa de uma carteira de ações, com alavancagem e posições vendidas à descoberto, títulos públicos e câmbio. Público Alvo: O fundo tem como público alvo investidores em geral que buscam performance diferenciada e entendam e estejam dispostos a assumir riscos inerentes a política de investimentos do fundo, que possui alavancagem.

A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. No momento do resgate, será aplicada a alíquota complementar em função do prazo da aplicação: até 180 dias, 22,5%; de 181 a 360 dias, 20%; de 361 a 720 dias, 17,5%; acima de 720 dias, 15%. A data de conversão de cotas é diversa da data de resgate e a data de pagamento do resgate é diversa da data do pedido de resgate. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Os fundos geridos pela VERSA utilizam 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. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

Tipo Anbima: Multimercado Macro - - Fundos que realizam operações em diversas classes de ativos (renda fixa, renda variável, câmbio etc.), definindo as estratégias de investimento baseadas em cenários macroeconômicos de médio e longo prazos.

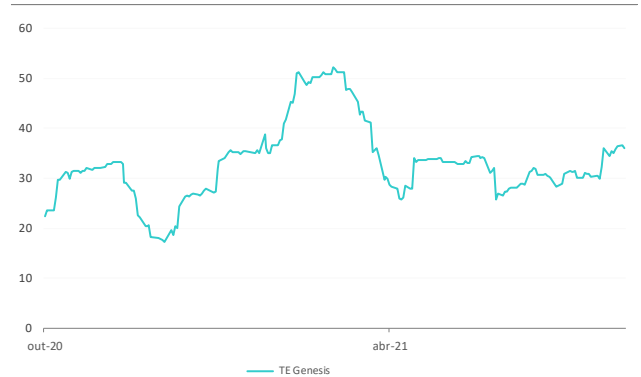
Em atendimento à Instrução CVM nº 465, desde 02/05/2008, os fundos de renda variável deixaram de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações e passou a fazê-lo com base na cotação de fechamento. Assim comparações de rentabilidade devem utilizar, para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média dos índices de ações e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.

# Versa Genesis FIA BDR Nível I

## Risco vs. Retorno

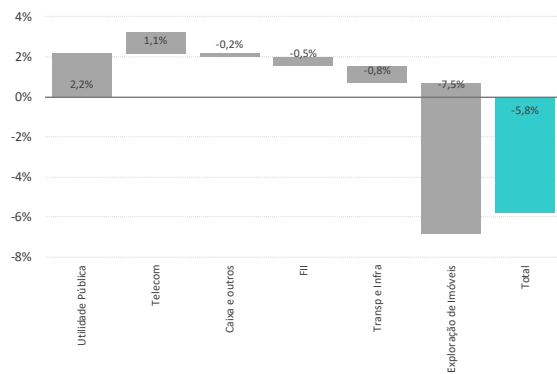
Parâmetro	
Valor da Cota	0,90653576
Patrimônio Líquido (em R\$MM)	11,63M
Patrimônio Líquido Médio de 12 meses (em R\$MM)	8,96M
Retorno Fundo (12 meses)	-9,3%
Risco	
Volatilidade Fundo 12 meses (a.a)	36,1%
Volatilidade Ibovespa 12 meses (a.a)	20,6%
Exposição Net	196,3%
Exposição Gross	196,3%
Exposição Gross (RV)	174,9%
Exposição Net (RV)	174,9%
Exposição Net (FX)	0,0%
Dados Históricos (desde o início)	
Retorno Fundo	-9,3%
Retorno IPCA+Yield IMA-B	12,1%
Retorno Ibovespa	18,4%
% de Meses Positivos	1,3%

## Tracking Error Histórico (% a.a)



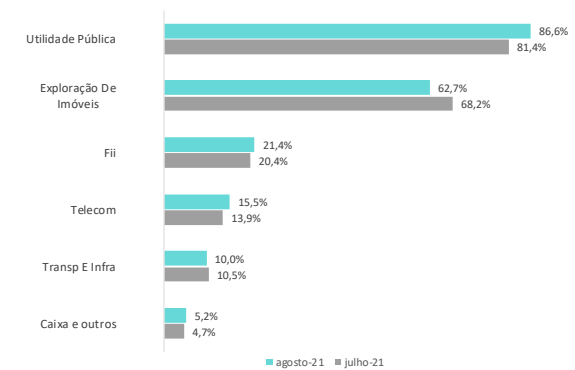
## Performance mensal

Data base: 31-08-2021



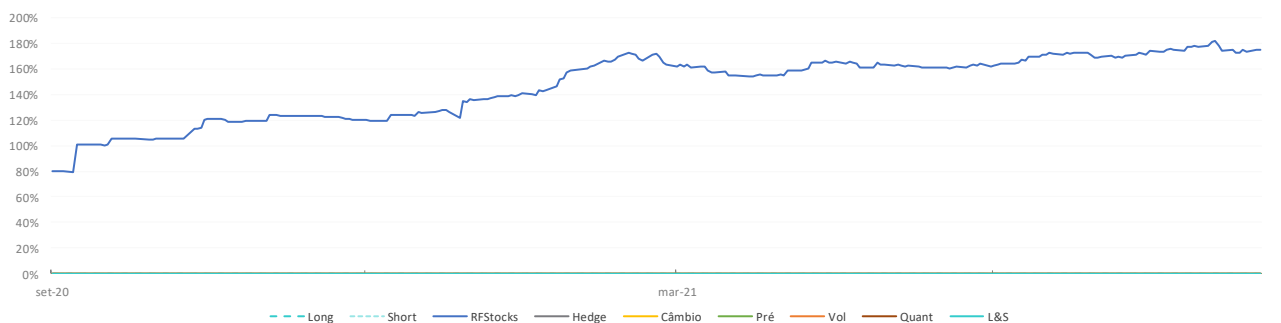
## Exposição (%)

Data base: 31-08-2021 / 30-07-2021



Caixa e outros: inclui contas a pagar/receber e custos como taxa de administração e performance

## Exposição Histórica por book



## Retorno Histórico

Ano		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	ANO
2021	Fundo	-9,0%	-14,2%	19,2%	-2,7%	10,7%	-10,0%	-4,0%	-5,8%	-	-	-	-	-18,4%
	Bench*	1,0%	0,5%	1,4%	0,7%	0,8%	1,0%	1,0%	1,2%	-	-	-	-	8,0%
	(+/-)	-10,0%	-14,8%	17,8%	-3,5%	9,9%	-11,1%	-5,0%	-7,0%	-	-	-	-	-26,5%
2020	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-7,2%	-3,5%	17,0%	6,0%	11,1%
	Bench*	-	-	-	-	-	-	-	-	0,4%	1,0%	1,0%	1,3%	3,7%
	(+/-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-7,5%	-4,5%	16,0%	4,7%	7,4%
2019	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Bench*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(+/-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2018	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Bench*	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	(+/-)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

# Versa Genesis FIA BDR Nível I



## Informações Gerais

Administrador	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVMS/A
Custodiante	BNY Mellon Banco S/A
Auditoria	KPMG Auditores Independentes S/A
CNPJ do fundo	37.829.310/0001-23
Início do Fundo	15/09/2020
Categoria ANBIMA	Ações Livre
Categoria CVM	Fundo de Ações
Código ANBIMA	-
Código Bloomberg	VSEGNEB:BZ

Taxa de Administração	2,00% a.a.
Taxa de Performance	20% sobre o que exceder o IPCA+Yield IMA-B, semestralmente com marca d'água
Tributação	Ações (alíquota: 15%)
Investimento Inicial	R\$500
Saldo Mínimo	R\$500
Movimentação Mínima	R\$100
Horário Limite	14:00
Aplicação	Conversão das cotas em D+1 (úteis)
Resgate	Conversão da cota em D+13 (úteis) e liquidação em D+15 (úteis).

## Disclaimer

Acesse outros documentos relevantes: <https://www.fundoversa.com.br/infos-regulatorias/>

Fonte de dados do material: VERSA Gestora de Recursos LTDA

Material de divulgação do fundo - Este material tem o único propósito de divulgar informações e dar transparência à gestão executada pela VERSA Gestora de Recursos LTDA. ("VERSA ASSET"), e não deve ser considerado como oferta de venda de cotas de fundos de investimento ou de qualquer título ou valor mobiliário e não constitui o prospecto previsto na Instrução CVM 409 ou no Código de Auto-Regulação da ANBID. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento social do Fundo de investimento pelo investidor ao aplicar os seus recursos. A VERSA não se responsabiliza por decisões de investimento tomadas com base neste material. O objetivo do fundo é alcançar o retorno dos títulos públicos atrelados à inflação utilizando ações com características comparáveis aos títulos. O fundo tem como público alvo investidores qualificados.

A rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Os rendimentos serão tributados no momento do resgate, à alíquota de 15%. A data de conversão de cotas é diversa da data de resgate e a data de pagamento do resgate é diversa da data do pedido de resgate. Fundos de investimento não contam com a garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC.

Os fundos geridos pela VERSA utilizam 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. Este fundo está autorizado a realizar aplicações em ativos financeiros no exterior.

Este fundo tem menos de 12 (doze) meses. Para avaliação de performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses

Tipo Anbima: Ações Livre - 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.

Em atendimento à Instrução CVM nº 465, desde 02/05/2008, os fundos de renda variável deixaram de apurar sua rentabilidade com base na cotação média das ações e passou a fazê-lo com base na cotação de fechamento. Assim comparações de rentabilidade devem utilizar, para períodos anteriores a 02/05/2008, a cotação média dos índices de ações e, para períodos posteriores a esta data, a cotação de fechamento. Os fundos de ações com renda variável podem estar expostos à significativa concentração em ativos de poucos emissores, com os riscos daí decorrentes.