



## LÂMINA DO FUNDO B3 MARGEM GARANTIA REFERENCIADO DI FIC FI

CNPJ: 08.627.607/0001-08

Informações referentes a 07/2018

Esta lâmina contém um resumo das informações essenciais sobre o B3 MARGEM GARANTIA REFERENCIADO DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO. As informações completas sobre esse fundo podem ser obtidas no Prospecto e no Regulamento do fundo, disponíveis no [www.bancob3.com.br](http://www.bancob3.com.br). As informações contidas neste material são atualizadas mensalmente. Ao realizar aplicações adicionais, consulte a sua versão mais atualizada.

### 1 - PÚBLICO-ALVO:

O FUNDO é destinado exclusivamente aos agentes econômicos responsáveis pelo cumprimento das obrigações assumidas em razão de operações realizadas e/ou registradas nos sistemas da B3, sendo a totalidade de suas cotas destinada ao atendimento de margem de garantia, por parte dos cotistas perante a B3, nos termos do Regulamento da Câmara de Registro, Compensação e Liquidação de Operações de Derivativos BMF.

**Restrições de Investimento:** Não há restrições de investimento.

### 2. OBJETIVOS DO FUNDO

O objetivo do FUNDO é proporcionar aos cotistas rentabilidade compatível com investimentos em ativos de renda fixa, mediante a aplicação dos recursos do FUNDO em cotas de Fundos de Investimento Financeiro (FIFs), de forma a acompanhar a tendência da variação das taxas de remuneração do Certificado de Depósito Interbancário (CDI).

### 3. POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Composição da Carteira/Percentual em Relação ao Patrimônio Líquido deverá obedecer às seguintes faixas de alocação: B3 DI Fundo de Investimento Renda Fixa Referenciado - de 95% a 100% e Depósitos a vista, títulos públicos federais e operações compromissadas, de acordo com regulamentação específica do Conselho Monetário Nacional (CMN) - de 0% a 5%

O fundo pode:

Aplicar em ativos no exterior até o limite de	0%
Aplicar em crédito privado até o limite de	0%
Alavancar-se até o limite de	0%
Concentrar seus ativos em um só emissor que não seja a União Federal até o limite de	0%

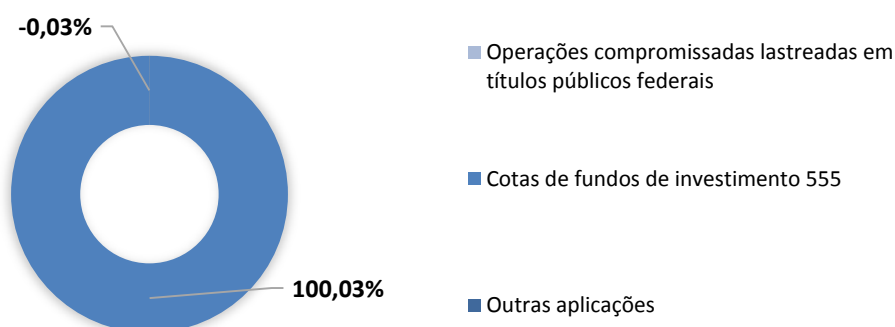
### 4. CONDIÇÕES DE INVESTIMENTOS

Investimento inicial mínimo	0,00
Investimento adicional mínimo	0,00
Resgate mínimo	0,00
Horário para aplicação e resgate	16:00
Valor mínimo para permanência	0,00
Período de carência	Não Há

<b>Conversão das cotas</b>	Na aplicação, o número de cotas compradas será calculado de acordo com o valor das cotas na abertura do <b>0º dia contado da data da aplicação</b> .
	<b>No resgate, o número de cotas canceladas será calculado de acordo com o valor das cotas na abertura do 0º dia contado da data do pedido de resgate.</b>
<b>Pagamento dos resgates</b>	<b>O prazo para o efetivo pagamento dos resgates é de 0 dia(s) útil(eis) contados da data do pedido de resgate.</b>
	<b>A taxa de administração pode variar de 0,3% a 0,5% do patrimônio líquido ao ano.</b>
<b>Taxa de administração</b>	<b>Comentários/Esclarecimentos por parte do fundo: Taxa mínima no percentual de 0,30% ao ano, sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO. Considerando-se que o FUNDO aplica em cotas de fundos de investimento, fica estabelecida a taxa de administração máxima de 0,50% ao ano sobre o valor do patrimônio líquido do FUNDO.</b>
<b>Taxa de entrada</b>	Não há taxa fixada.
	Outras condições de entrada: <b>Não há.</b>
<b>Taxa de saída</b>	Para resgatar suas cotas do <b>fundo</b> o investidor paga uma taxa de 0% do valor do resgate, que é deduzida diretamente do valor a ser recebido.
	Outras condições de saída: <b>Não há.</b>
<b>Taxa de performance</b>	<b>Não há</b>
<b>Taxa total de despesas</b>	As despesas pagas pelo fundo representaram <b>0,027427%</b> do seu patrimônio líquido diário médio no período que vai de <b>02/07/2018</b> a <b>31/07/2018</b> . A taxa de despesas pode variar de período para período e reduz a rentabilidade do fundo. O quadro com a descrição das despesas do fundo pode ser encontrado em <b>8 b</b> .

## 5. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA: [i]

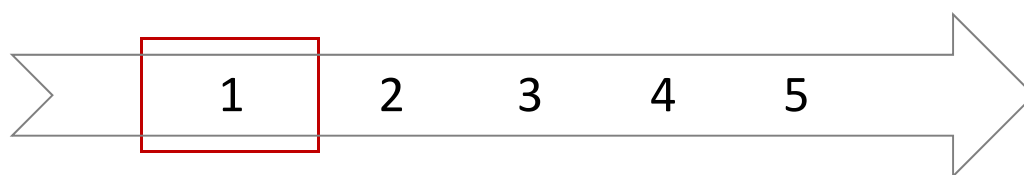
O patrimônio líquido do fundo é de R\$64.154.536,79 e as 5 espécies de ativos em que ele concentra seus investimentos são [ii] e [iii]:



A data base das informações acima é o último dia útil do mês/ano de referência da Lâmina.

## 6. RISCO

O Banco B3 classifica os fundos que administra numa escala de 1 a 5 de acordo com o risco envolvido na estratégia de investimento de cada um deles. Nessa escala, a classificação do fundo é:



## 7. HISTÓRICO DE RENTABILIDADE

[iv] (para fundos não estruturados [v]) / SIMULAÇÃO DE DESEMPENHO (fundos estruturados [v])

- a. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
- b. **Rentabilidade acumulada nos últimos 5 anos:** 59,26% No mesmo período o índice de referência [CDI] variou 63,141%.

A tabela abaixo mostra a rentabilidade do fundo a cada ano nos últimos 5 anos.

Tabela de Rentabilidade Anual

Ano	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do índice de referência [CDI]	Desempenho do fundo como % do índice de referência [CDI]	Comentários/Esclarecimentos por parte do Fundo
2018	3,39%	3,74%	90,82%	
2017	9,36%	9,95%	94,01%	
2016	13,37%	14,00%	95,49%	
2015	12,66%	13,23%	95,67%	
2014	10,29%	10,81	95,21%	

Tabela de Rentabilidade Mensal

Mês [vii]	Rentabilidade (líquida de despesas, mas não de impostos)	Variação percentual do índice de referência [CDI]	Desempenho do fundo como % do índice de referência [CDI]	Comentários/Esclarecimentos por parte do Fundo
7	0,49%	0,54%	90,74%	
6	0,48%	0,52%	92,31%	
5	0,45%	0,52%	86,54%	
4	0,47%	0,52%	90,38%	
3	0,49%	0,53%	92,45%	
2	0,43%	0,47%	91,49%	
1	0,54%	0,58%	93,10%	
12	0,50%	0,54%	92,59%	
11	0,52%	0,57%	91,23%	
10	0,60%	0,65%	92,31%	
9	0,60%	0,64%	93,75%	
8	0,75%	0,80%	93,76%	

- c. **Exemplo do desempenho do fundo:** Os cenários e desempenhos descritos abaixo são meramente exemplificativos e servem somente para demonstrar como a fórmula de cálculo da rentabilidade funciona:

<b>Varição do desempenho do Fundo</b>	<b>Fórmula de cálculo da rentabilidade</b>	<b>Valores dos cenários/gatilhos que afetam a rentabilidade</b>	<b>Esclarecimentos sobre como o cenário/gatilho afeta a variação de desempenho do fundo</b>
93,85%	(Rentabilidade Fundo / Rentabilidade do Benchmark) dos últimos 5 anos		

## 8. EXEMPLO COMPARATIVO

[viii] utilize a informação do exemplo abaixo para comparar os custos e os benefícios de investir no fundo com os de investir em outros fundos.

a. Rentabilidade: Se você tivesse aplicado R\$ 1.000,00 (mil reais) no fundo no primeiro dia útil de 2017 e não houvesse realizado outras aplicações, nem solicitado resgates durante o ano, no primeiro dia útil de 2018, você poderia resgatar R\$ 1.074,85, já deduzidos impostos no valor de R\$ 18,71.

A taxa de ingresso teria custado R\$ 0,00. A taxa de saída teria custado R\$ 0,00. O ajuste sobre performance individual teria custado R\$ 0,00.

b. Despesas: As despesas do fundo, incluindo a taxa de administração, a taxa de performance (se houver), e as despesas operacionais e de serviços teriam custado R\$ 0,27.

## 9. SIMULAÇÃO DE DESPESAS

[ix] utilize a informação a seguir para comparar o efeito das despesas em períodos mais longos de investimento entre diversos fundos:

Assumindo que a última taxa total de despesas divulgada se mantenha constante e que o fundo tenha rentabilidade bruta hipotética de 10% ao ano nos próximos 3 e 5 anos, o retorno após as despesas terem sido descontadas, considerando a mesma aplicação inicial de R\$ 1.000,00 (mil reais), é apresentado na tabela abaixo:

<b>SIMULAÇÃO DE DESPESAS</b>	<b>[+3 ANOS]</b>	<b>[+5 ANOS]</b>
Saldo bruto acumulado (hipotético - rentabilidade bruta anual de 5%)	<b>R\$ 1.331,00</b>	<b>R\$ 1.610,51</b>
Despesas previstas (se a TAXA TOTAL DE DESPESAS se mantiver constante)	<b>R\$ 0,36</b>	<b>R\$ 0,44</b>
Retorno bruto hipotético após dedução das despesas e do valor do investimento original (antes da incidência de impostos, de taxas de ingresso e/ou saída, ou de taxa de performance)	<b>R\$ 330,63</b>	<b>R\$ 610,06</b>

Este exemplo tem a finalidade de facilitar a comparação do efeito das despesas no longo prazo. Esta simulação pode ser encontrada na lâmina e na demonstração de desempenho de outros fundos de investimento.

A simulação acima não implica promessa de que os valores reais ou esperados das despesas ou dos retornos serão iguais aos aqui apresentados.

## 10. SERVIÇO DE ATENDIMENTO AO COTISTA

a. Telefone: Favor contatar o distribuidor de cotas

b. Página na rede mundial de computadores [www.bancob3.com.br](http://www.bancob3.com.br)

c. Reclamações: Favor contatar o distribuidor de cotas

## 11. SUPERVISÃO E FISCALIZAÇÃO

a. Comissão de Valores Mobiliários - CVM

b. Serviço de Atendimento ao Cidadão em <http://www.cvm.gov.br>.

[i] Item dispensado nas lâminas apresentadas para registro do fundo, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[ii] Quando se tratar de fundo de investimento em cotas FIC, a informação deve ser dada em relação à carteira dos fundos investidos.

[iii] Para efeito de preenchimento, as espécies de ativos são: Espécie de ativo	Descrição
Títulos públicos federais	Tesouro Prefixado; Tesouro SELIC; todas as séries de Tesouro IPCA
Operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais	Operações de compra ou venda de ativos pelo fundo com garantia de recompra ou revenda pelo vendedor
Operações compromissadas lastreadas em títulos privados	Operações de compra ou venda de ativos pelo fundo com garantia de recompra ou revenda pelo vendedor
Ações	Ações e certificados de depósito de ações de companhias abertas
Depósitos a prazo e outros títulos de instituições financeiras	CDB, RDB, LF, DPGE, CCCB, LCA, LCI
Cotas de fundos de investimento 555	Cotas de fundos de investimento regulados pela Inst. CVM nº 555, de 2014
Outras cotas de fundos de investimento	Cotas de fundos de investimento regulados por outras instruções da CVM.
Títulos de crédito privado	Debêntures, notas promissórias, <b>commercial paper</b> , <b>export note</b> , CCB, CPR, WA, NCA, CDA e CDCA
Derivativos	Swaps, opções, operações a termo e operações no mercado futuro
Investimento no exterior	Ativos financeiros adquiridos no exterior
Outras aplicações	Qualquer aplicação que não possa ser classificada nas opções anteriores

[iv] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[v] Os fundos estruturados são definidos no OFÍCIO-CIRCULAR/CVM/SIN/Nº01/2010, de 8 de janeiro de 2010.

[vi] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[vii] Meses devem ser ajustados de acordo com a data de atualização da lâmina.

[viii] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.

[ix] Item dispensado nas lâminas apresentadas na instrução do pedido de registro e até que o fundo complete 1 (um) ano de operação, nos termos do art. 8º, inciso VIII.