

CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

1. Informações dos Contratos Disponíveis

ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO

PU DO CONTRATO (PONTOS)	100.000
VALOR DO PONTO (BRL)	0,00025
TICK SIZE	0,01%
LOTE PADRÃO	5

INFORMAÇÕES DE MERCADO

DATA	17/08/2020
DI	1,90%

DADOS DE INFLAÇÃO

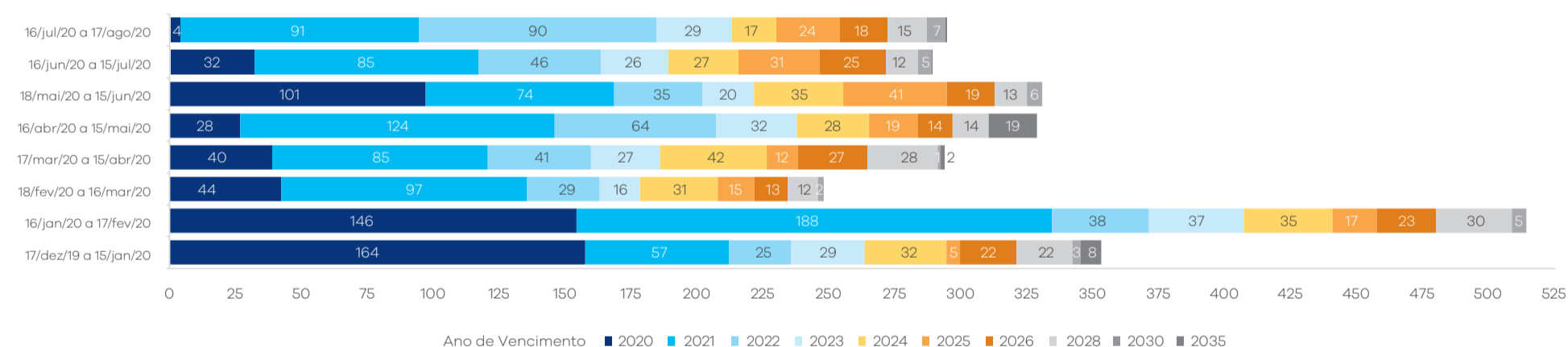
DATA INÍCIO	15/07/2020	
DATA FIM	17/08/2020	
DU MÊS TOTAL	23	
ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL	5.325,46	
1ª PRÉVIA IPCA	10/07/2020	0,51%
2ª PRÉVIA IPCA	24/07/2020	0,37%
IPCA IBGE	07/08/2020	0,36%
ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO	5.344,63	

CÓDIGO B3	CÓDIGO BBG	VENCIMENTO	DU	TAXA	PU	BPV*	MARGEM**
DAPU20	WLU20 Index	15/09/2020	20	1,12%	99.911,64	1,05	0,70%
DAPV20	WLV20 Index	15/10/2020	41	0,36%	99.941,55	2,16	0,72%
DAPX20	WLX20 Index	16/11/2020	62	-0,43%	100.106,08	3,30	0,82%
DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	104	-1,20%	100.499,48	5,61	1,00%
DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	186	-0,94%	100.699,53	10,02	1,50%
DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	356	-0,37%	100.525,04	19,04	2,34%
DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	501	0,06%	99.880,82	26,51	2,72%
DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	687	0,54%	98.542,54	35,70	3,73%
DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.003	1,54%	94.098,58	49,27	5,01%
DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1.190	1,98%	91.157,05	56,38	5,70%
DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.508	2,48%	86.364,28	67,36	6,92%
DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.009	3,03%	78.822,55	81,46	8,81%
DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.509	3,40%	71.685,03	92,18	10,47%
DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.702	3,81%	57.734,92	109,08	15,09%

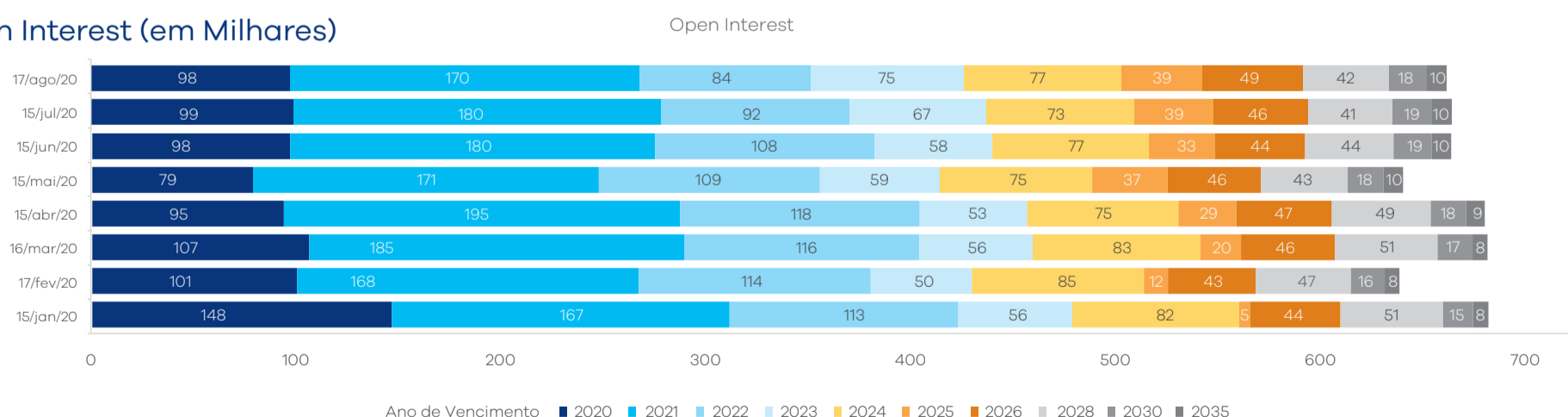
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

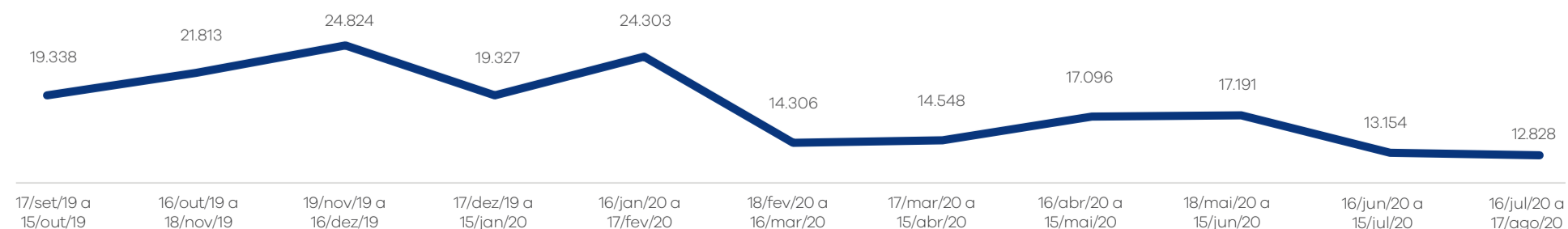
Contratos Negociados (em Milhares)



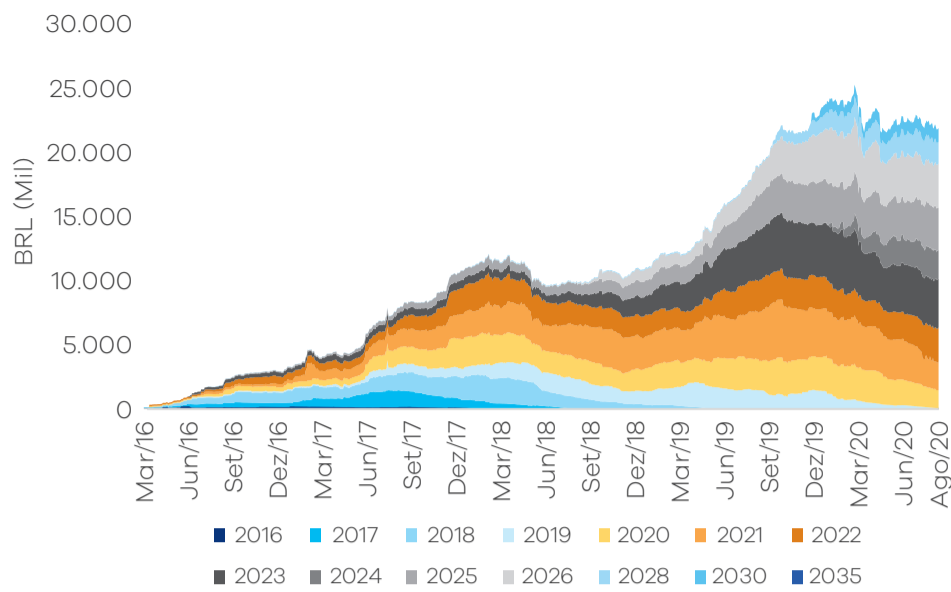
Open Interest (em Milhares)



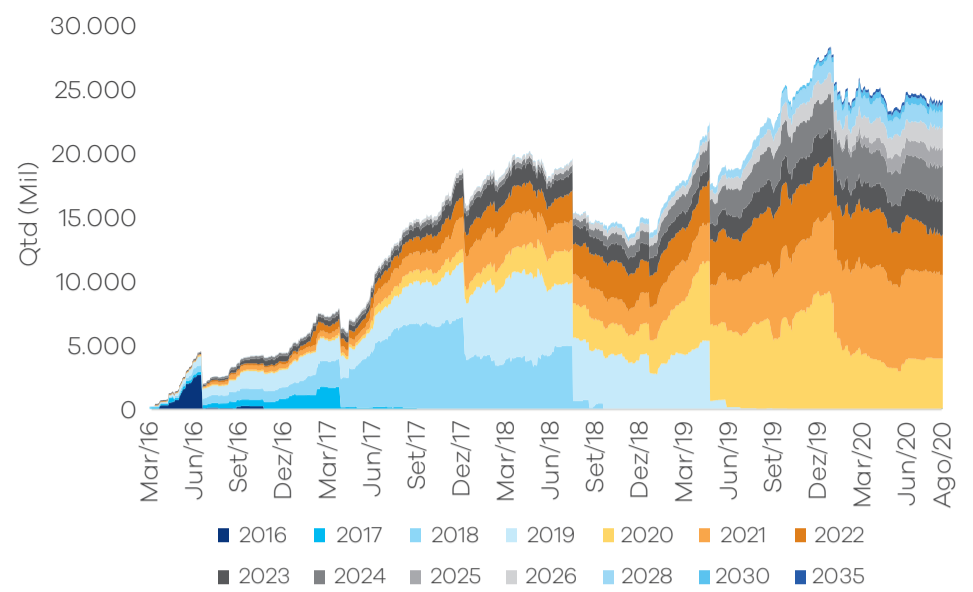
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



3. Programa de Formador de Mercado

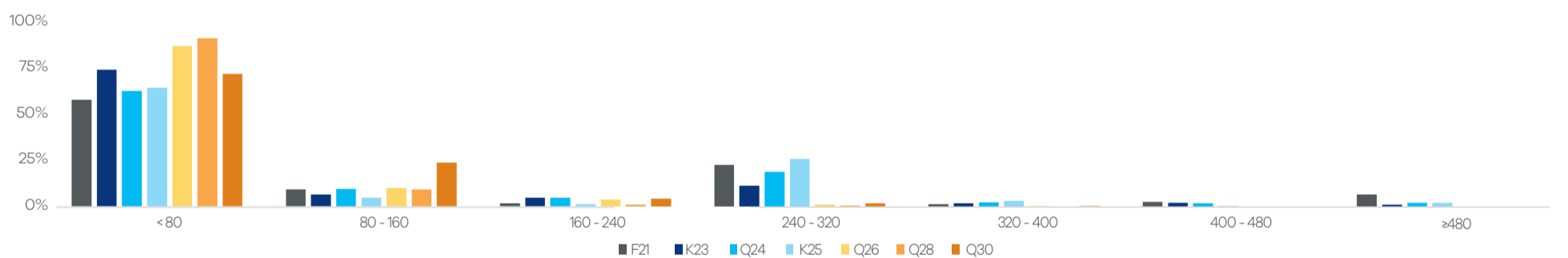
Obrigações do Formador de Mercado

FORMADOR DE MERCADO		PERÍODO DE ATUAÇÃO	VENCIMENTOS	MODELO A		MODELO B				HORÁRIOS			
MODELO A	MODELO B			CAMADA 1		CAMADA 1*		CAMADA 2*					
				SPREAD MÁXIMO	QUANTIDADE MÍNIMA	SPREAD MÁXIMO	QUANTIDADE MÍNIMA	SPREAD MÁXIMO	QUANTIDADE MÍNIMA				
Itaú Santander	Mercury TMG	02/05/2020 a 14/07/2020	14 bps	300	12 bps	120	5 bps	10	Formadores atuam na sessão de negociação (80% do período das 10h30 a 12h e 15h a 16h50) e no call de fechamento (durante 1 minuto e 10 segundos por vencimento obrigatório)				
		15/07/2020 a 14/09/2020								20 bps	18 bps	7 bps	
		15/09/2020 a 14/04/2021	10 bps		100	8 bps	3 bps						
		15/04/2021 a 30/04/2021	14 bps			12 bps				5 bps			
		02/05/2020 a 30/04/2021	Mai/23		10 bps	240	8 bps			80	3 bps		
			Ago/24		10 bps		8 bps				3 bps		
			Mai/25		10 bps		8 bps				60	3 bps	
			Ago/26		10 bps		60				8 bps	50	4 bps
			Ago/28		15 bps		60				10 bps	40	4 bps
		Ago/30	15 bps		100	13 bps	40			5 bps	5		

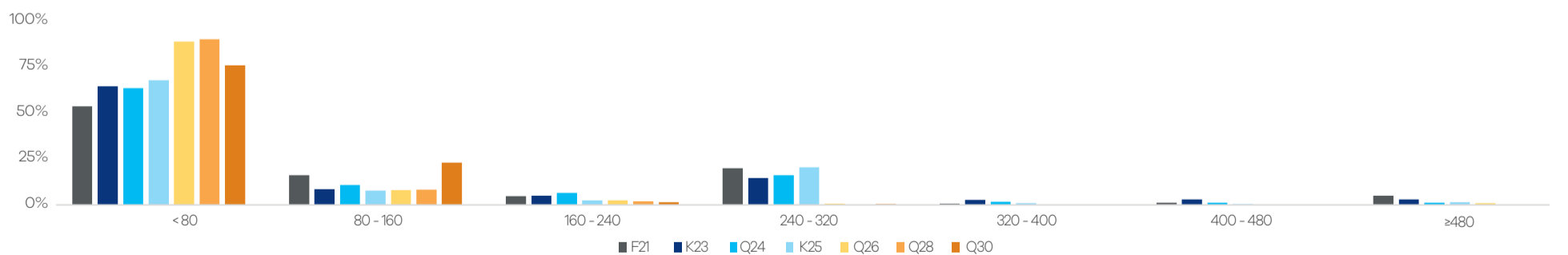
*Atuação simultânea em ambas as camadas

4. Vencimentos Mais Líquidos - Informações do Topo do Livro (16/07 a 17/08)

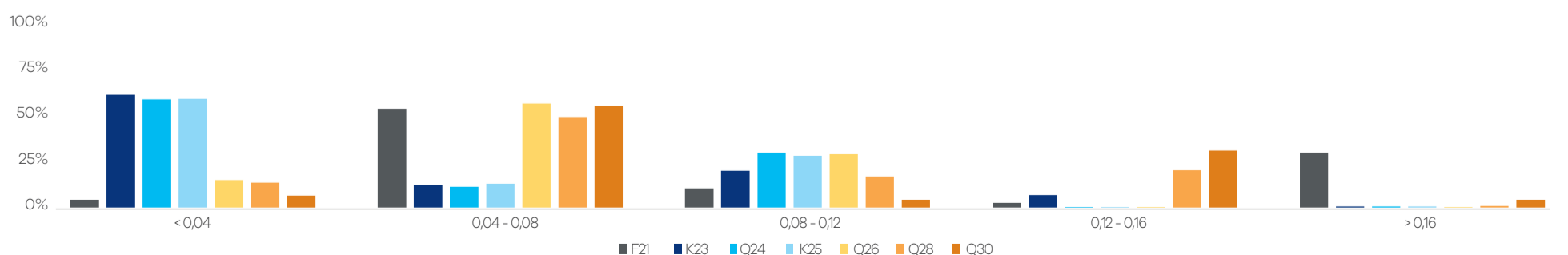
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

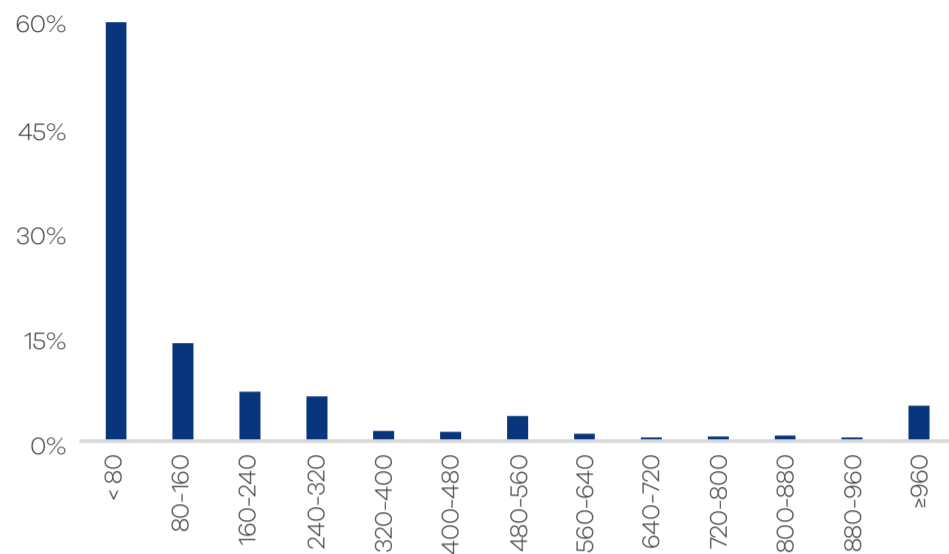


Spread Médio

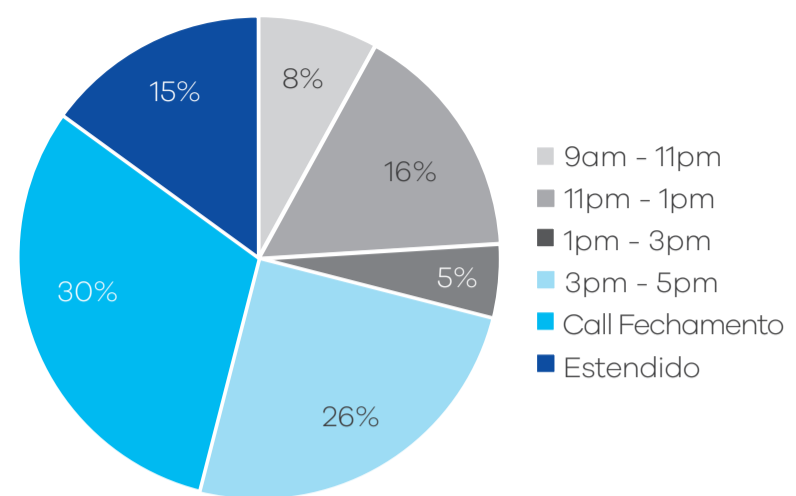


5. Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

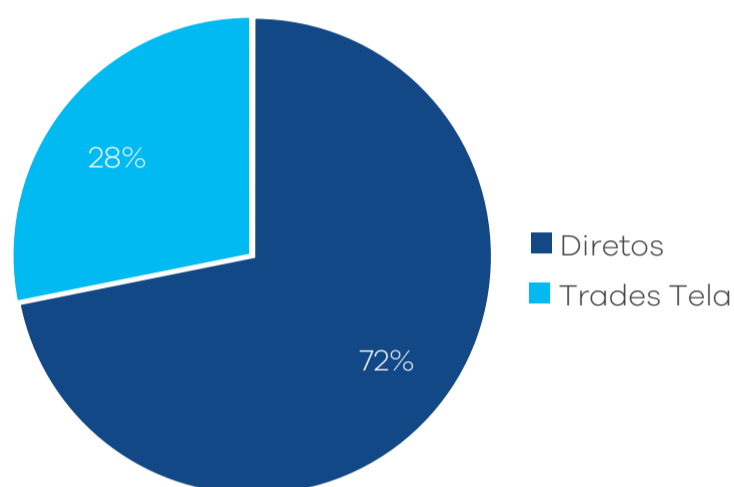


Por Janelas de Negociação



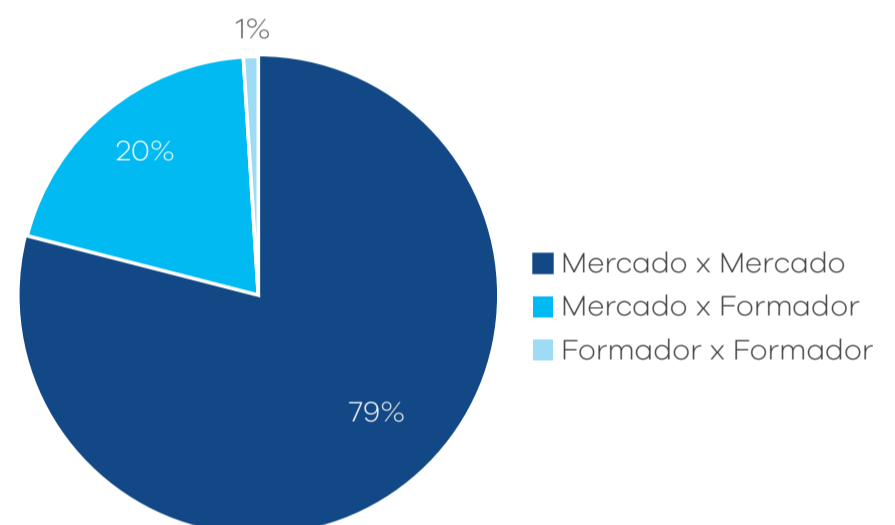
6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

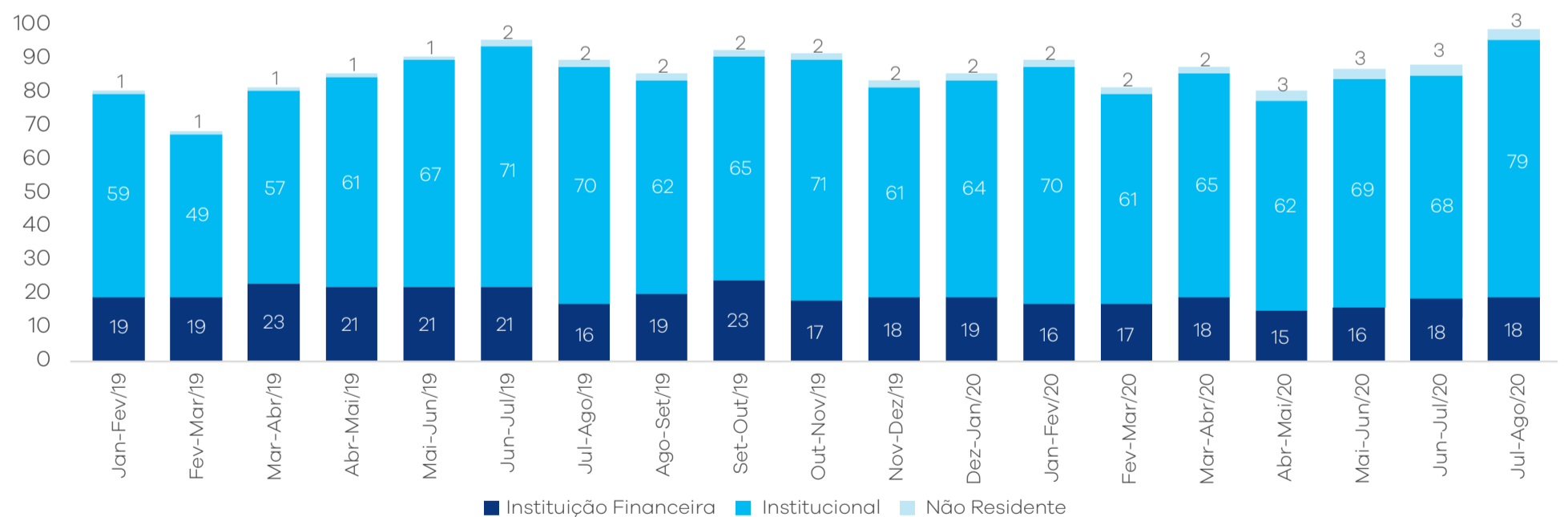


7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Contate-nos

B3 clientes CLIENTES.B3.COM.BR
Institucional B3.COM.BR

