

## Informações Contratos Disponíveis

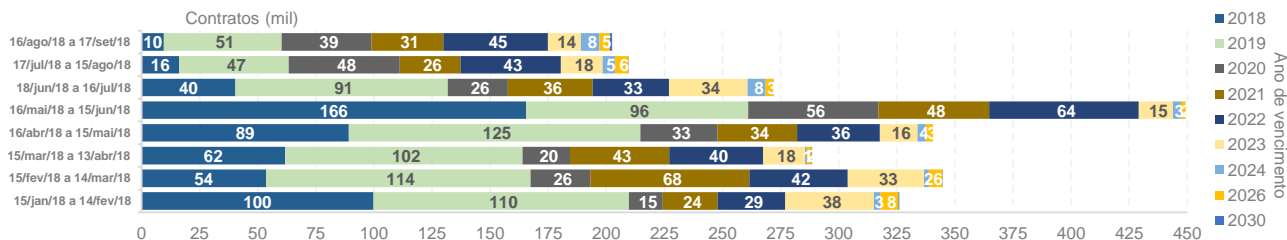
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	DV01*	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPV18	WLV8 Index	15/10/2018	19	1,20%	99.910,10	0,94	0,58%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPX18	WLX8 Index	15/11/2018	40	2,50%	99.608,82	1,95	0,57%	
Tick Size	0,01%	DAPZ18	WLZ8 Index	17/12/2018	62	2,28%	99.446,88	3,02	0,56%	
Lote padrão	5	DAPF19	WLF9 Index	15/01/2019	81	1,85%	99.412,52	3,97	0,58%	
Informações de Mercado		DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	334	3,53%	95.506,14	15,45	1,88%	
Data	17/09/2018	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	481	4,01%	92.770,15	21,52	2,46%	
DI	6,39%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	667	4,75%	88.441,44	28,25	3,26%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	982	5,52%	81.108,88	37,86	4,41%	
Data início	15/08/2018	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.168	5,61%	77.647,77	43,07	4,98%	
Data fim	17/09/2018	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.484	5,89%	71.389,11	50,17	6,14%	
DU Mês Total	22	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.989	5,98%	63.228,26	59,50	7,98%	
Índice Inflação Inicial	5.061,11	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.490	6,01%	56.175,78	66,16	9,92%	
1ª Prévia IPCA	08/08/2018	0,03%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.990	5,85%	50.937,89	72,14	11,67%
2ª Prévia IPCA	23/08/2018	0,00%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	4.183	5,88%	38.735,43	76,70	15,95%
Índice Pro-Rata Calculado	5.056,56									

\*Por contrato

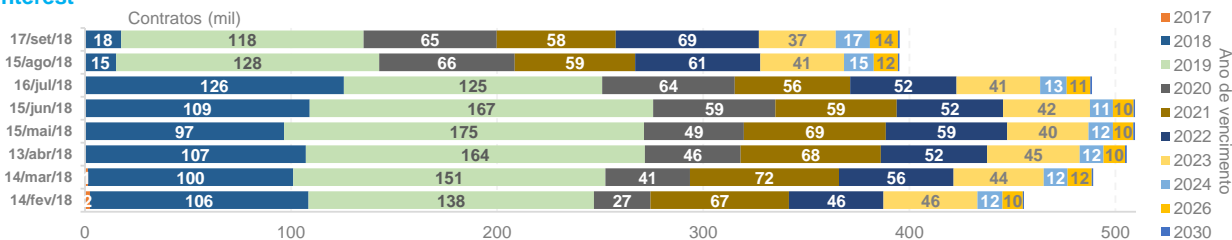
\*\*Margem Teórica Máxima em % do PU

## Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

### Contratos Negociados (desde 15/jan/18)



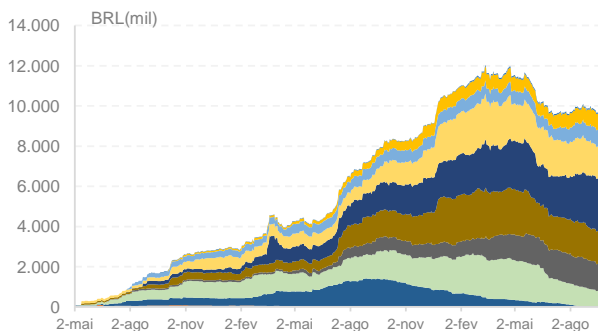
### Open Interest



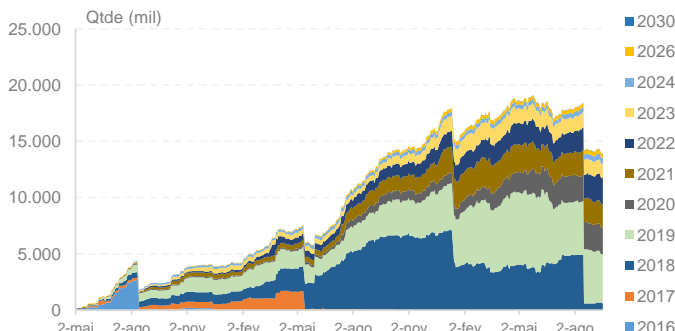
### ADV (Contratos)



### Open Interest em DV01 Equivalente



### Open Interest em NTN-B Equivalente



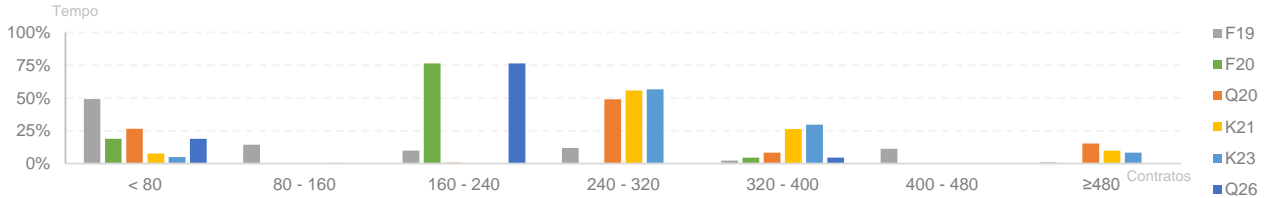
## Programa de Formador de Mercado

### Obrigações do Formador de Mercado

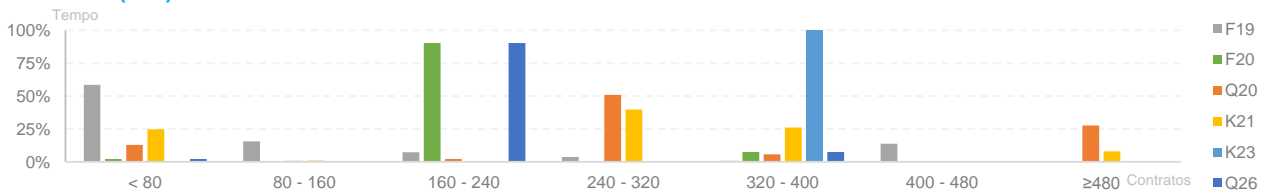
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/19 (F19), JAN/20 (F20), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), MAI/23 (K23) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 300 contratos (F19, F20, Q20, K21 e K23) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 24 bps (F19), 10 bps (Q20, K21 e K23), 12 bps (F20) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander 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)

### Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro em Agosto/18

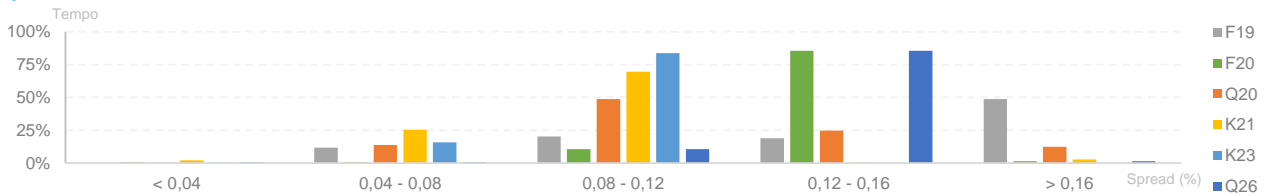
#### Lote Médio (Bid)



#### Lote Médio (Ask)

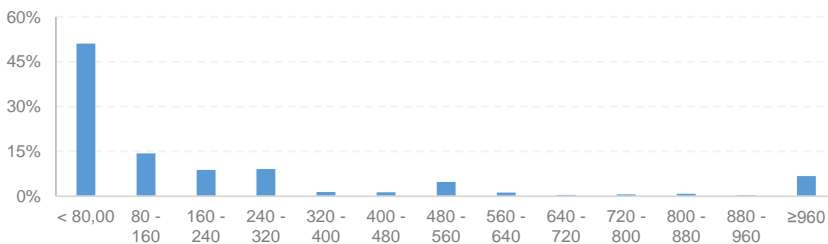


#### Spread Médio

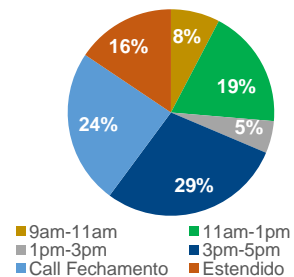


### Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

#### Por Lote Executado

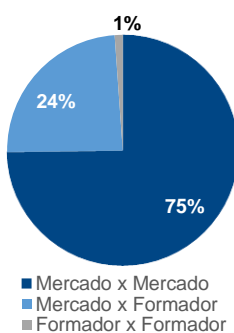


#### Por Janelas de Negociação

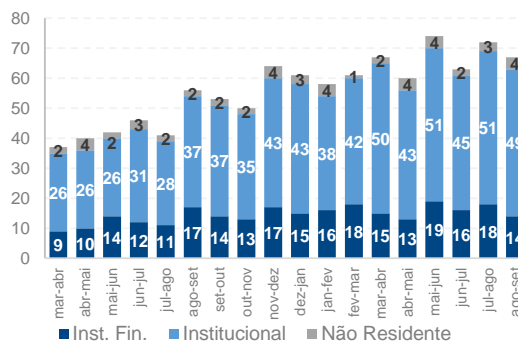


### Participação por Tipo de Investidor

#### Breakdown Participação FM



#### Número de Instituições Negociando DAP



### Negociação em Tela

#### Diretos Intencionais

