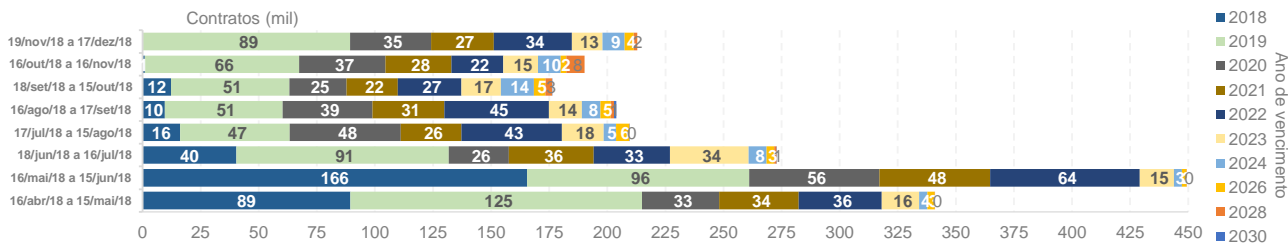


Informações Contratos Disponíveis

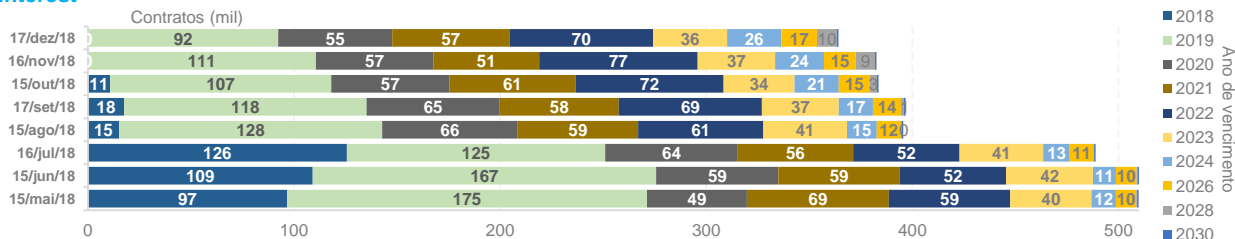
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPF19	WLF9 Index	15/01/2019	19	5,58%	99.591,44	0,91	0,73%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPG19	WLG9 Index	15/02/2019	42	4,19%	99.318,24	2,02	0,76%	
Tick Size	0,01%	DAPK19	WLK9 Index	15/05/2019	101	3,08%	98.791,55	4,89	1,01%	
Lote padrão	5	DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	272	2,95%	96.910,66	12,94	1,98%	
Informações de Mercado		DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	419	3,26%	94.805,84	19,43	2,48%	
Data	17/12/2018	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	605	3,59%	91.880,86	27,11	3,21%	
DI	6,40%	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	920	4,22%	85.993,25	38,35	4,55%	
Dados de Inflação		DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.106	4,39%	82.814,84	44,32	5,23%	
Data início	17/11/2018	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.422	4,63%	77.460,93	53,17	6,39%	
Data fim	17/12/2018	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.927	4,84%	69.668,03	64,67	8,28%	
DU Mês Total	20	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.428	4,95%	62.782,10	73,35	9,99%	
Índice Inflação Inicial	5.103,69	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.928	4,98%	56.854,10	80,07	11,72%	
1ª Prévia IPCA	05/10/2018	-0,05%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	4.121	5,07%	44.540,44	88,19	16,14%
2ª Prévia IPCA	23/10/2018	-0,08%	*Por contrato		**Margem Teórica Máxima em % do PU					
IPCA IBGE	10/11/2018	-0,21%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.092,97									

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



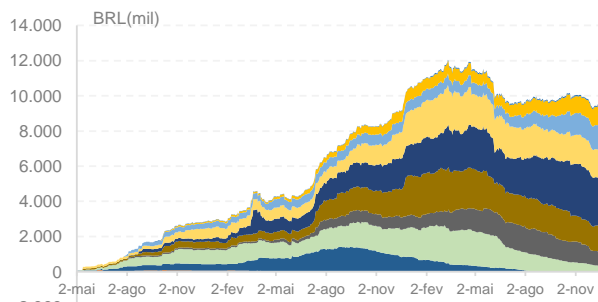
Open Interest



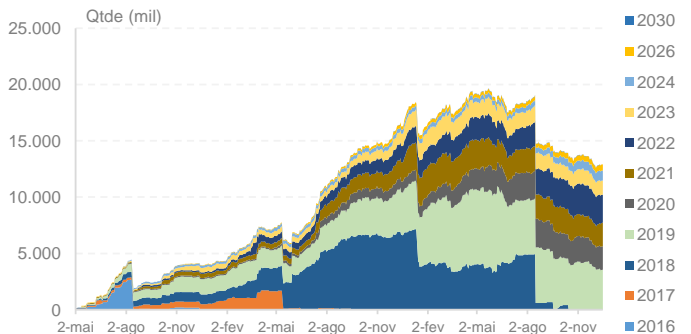
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



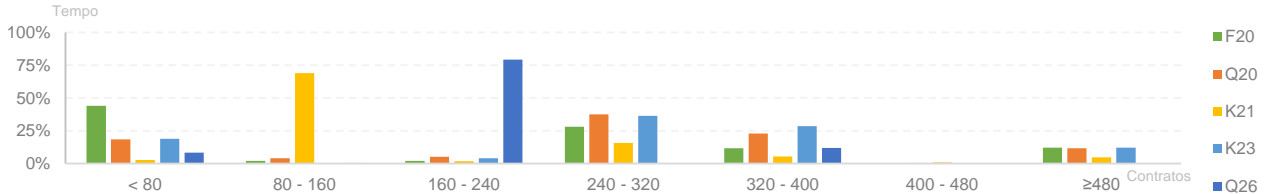
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

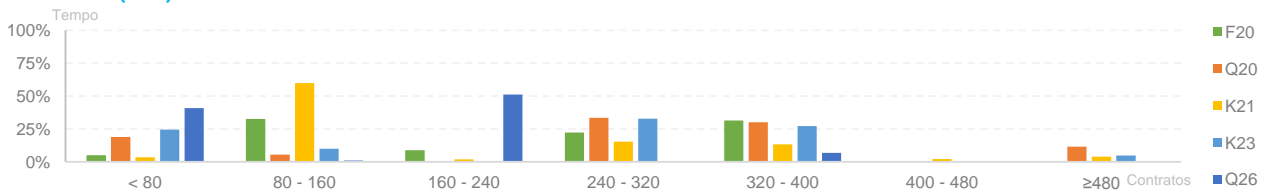
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/20 (F20), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), MAI/23 (K23) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 300 contratos (F20, Q20, K21 e K23) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 10 bps (Q20, K21 e K23), 12 bps (F20) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam 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 Novembro/18

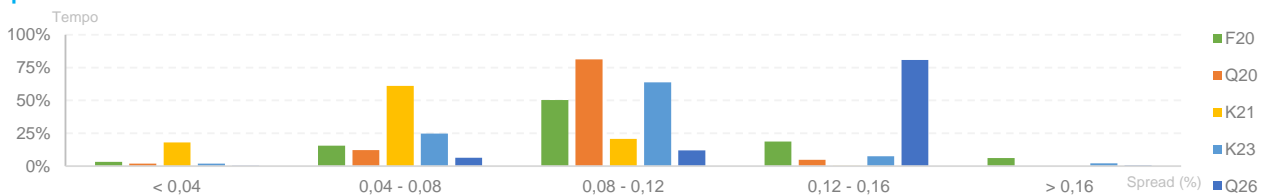
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

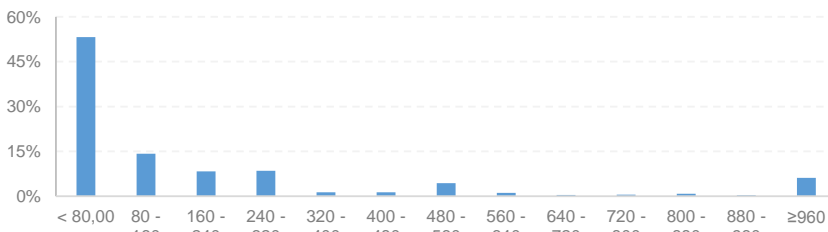


Spread Médio

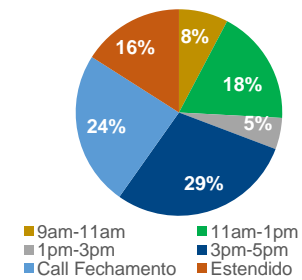


Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

Por Lote Executado

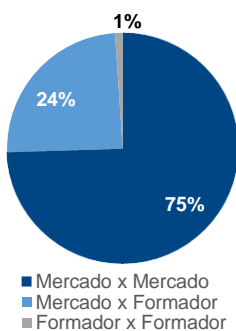


Por Janelas de Negociação

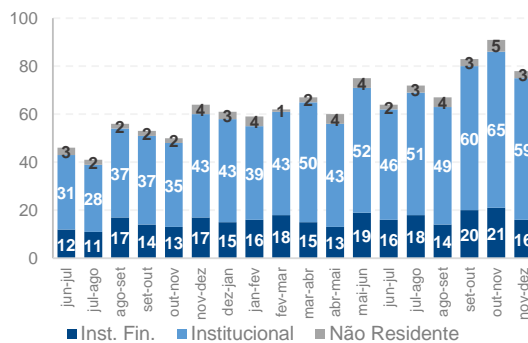


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

