

## Informações Contratos Disponíveis

100

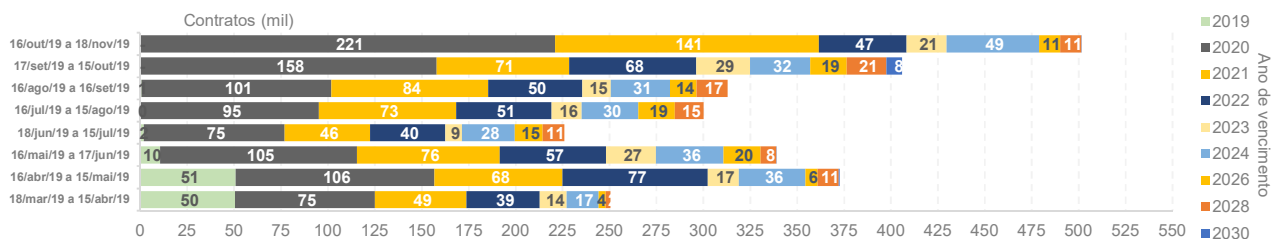
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPZ19	WLZ19 Index	16/12/2019	20	-1,11%	100.088,63	1,05	0,67%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPF20	WLF0 Index	15/01/2020	40	-1,22%	100.195,03	2,11	0,72%	
Tick Size	0,01%	DAPG20	WLG20 Index	17/02/2020	63	-0,86%	100.216,16	3,31	0,81%	
Lote padrão	5	DAPK20	WLK20 Index	15/05/2020	122	-0,34%	100.165,02	6,37	1,06%	
Informações de Mercado		DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	187	-0,03%	100.022,27	9,71	1,49%	
Data	18/11/2019	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	291	0,57%	99.345,80	14,92	2,07%	
DI	4,90%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	373	0,61%	99.103,89	19,07	2,36%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	688	1,42%	96.223,60	33,88	3,70%	
Data início	15/10/2019	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	874	1,80%	94.000,19	41,89	4,48%	
Data fim	18/11/2019	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.190	2,25%	90.025,94	54,38	5,67%	
DU Mês Total	23	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.695	2,70%	83.593,98	71,60	7,57%	
Índice Inflação Inicial	5.227,84	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.196	3,04%	77.030,60	85,19	9,44%	
1ª Prévia IPCA	16/10/2019	0,06%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.696	3,21%	71.317,93	96,66	11,26%
2ª Prévia IPCA	23/10/2019	0,08%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.889	3,42%	59.513,43	116,09	16,06%
IPCA IBGE	07/11/2019	0,10%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.233,07									

\*Por contrato

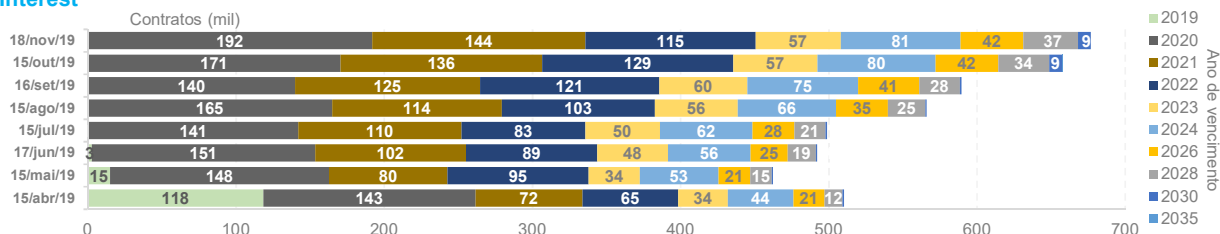
\*\*Margem Teórica Máxima em % do PU

## Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

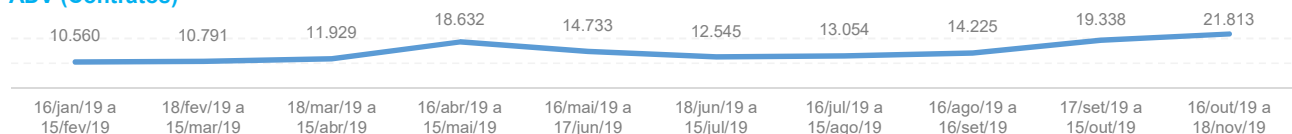
### Contratos Negociados



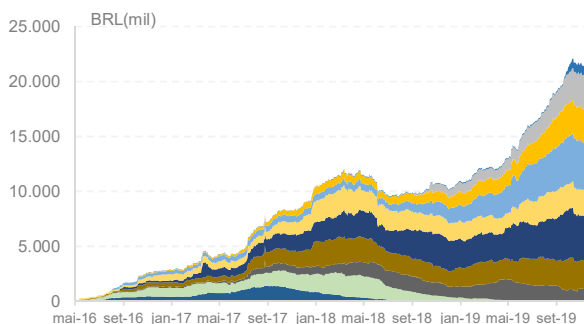
### Open Interest



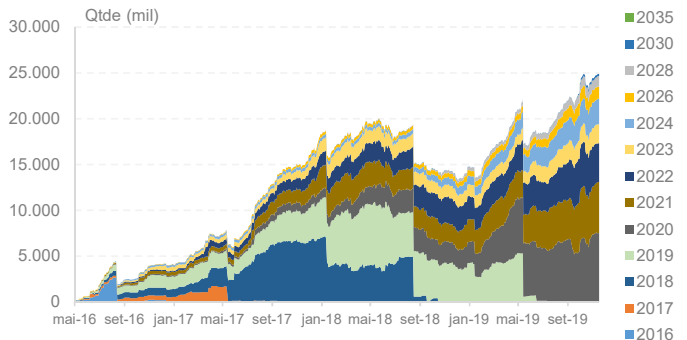
### ADV (Contratos)



### Open Interest em DV01 Equivalente



### Open Interest em NTN-B Equivalente



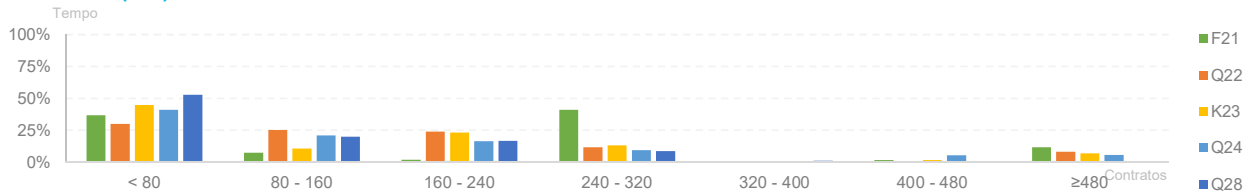
## Programa de Formador de Mercado

### Obrigações do Formador de Mercado

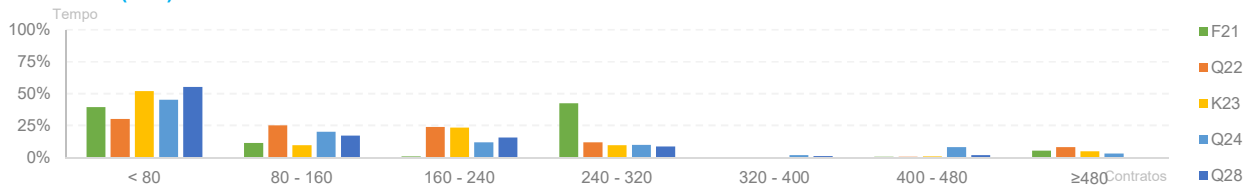
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/21 (F21), AGO/22 (Q22), MAI/23 (K23), AGO/24 (Q24) e AGO/28 (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo A*: 300 contratos (F21, Q22, K23 e Q24) e 160 contratos (Q28) na compra e na venda
- Spread Máximo *Modelo A*: 10 bps (F21, Q22, K23 e Q24) e 15 bps (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo B*: 120 contratos (F21), 100 contratos (Q22 e K23), 80 contratos (Q24) e 60 contratos (Q28)
- Spread Máximo *Modelo B*: 8 bps (F21 e Q24), 6 bps (Q22 e K23) e 13 bps (Q28)
- Presença em tela: Itaú, Santander, TMG e Mercury 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/19

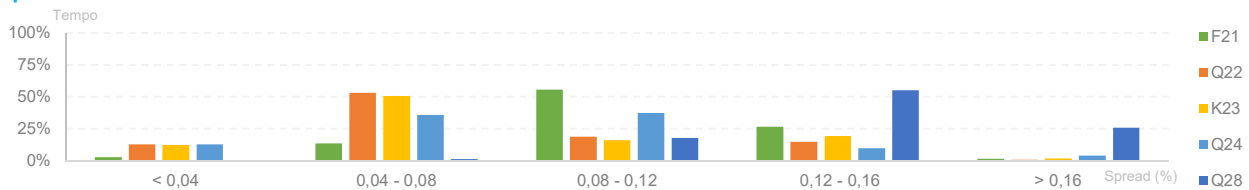
### Lote Médio (Bid)



### Lote Médio (Ask)

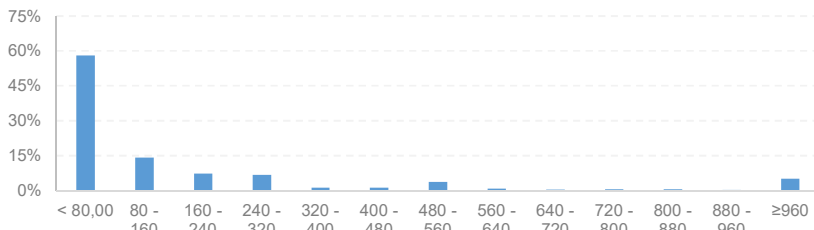


### Spread Médio

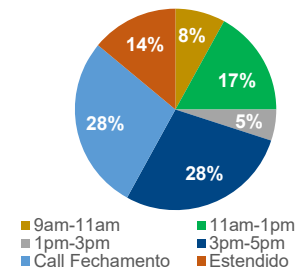


## Frequência de Execução de Ordens

### Por Lote Executado

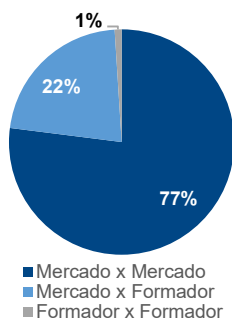


### Por Janelas de Negociação

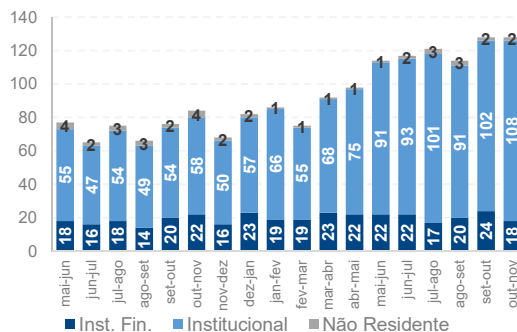


## Participação por Tipo de Investidor

### Breakdown Participação FM



### Número de Instituições Negociando DAP



## Negociação em Tela

### Diretos Intencionais

