

Informações Contratos Disponíveis

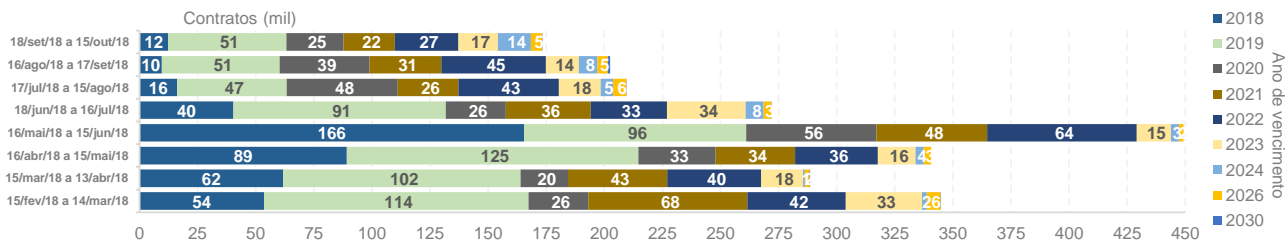
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	DV01*	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPX18	WLX8 Index	16/11/2018	22	0,65%	99.943,45	1,10	0,58%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPZ18	WLZ8 Index	17/12/2018	43	2,22%	99.626,04	2,11	0,56%	
Tick Size	0,01%	DAPF19	WLF9 Index	15/01/2019	62	1,86%	99.547,61	3,05	0,82%	
Lote padrão	5	DAPK19	WLK9 Index	15/05/2019	144	2,13%	98.802,86	7,02	0,83%	
Informações de Mercado		DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	315	2,94%	96.442,80	14,87	1,78%	
Data	15/10/2018	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	462	3,50%	93.887,84	21,12	2,34%	
DI	6,40%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	648	3,96%	90.496,04	28,43	3,18%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	963	4,65%	84.055,85	38,98	4,38%	
Data início	17/09/2018	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.149	4,83%	80.648,35	44,54	5,00%	
Data fim	15/10/2018	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.465	5,05%	75.095,55	52,77	6,15%	
DU Mês Total	19	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.970	5,25%	67.031,60	63,21	8,10%	
Índice Inflação Inicial	5.056,56	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.471	5,51%	59.100,76	69,73	10,37%	
1ª Prévia IPCA	06/09/2018	0,32%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.971	5,38%	53.912,33	76,57	12,19%
2ª Prévia IPCA	21/09/2018	0,40%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	4.164	5,42%	41.804,64	83,16	16,60%
Índice Pro-Rata Calculado	5.080,83									

*Por contrato

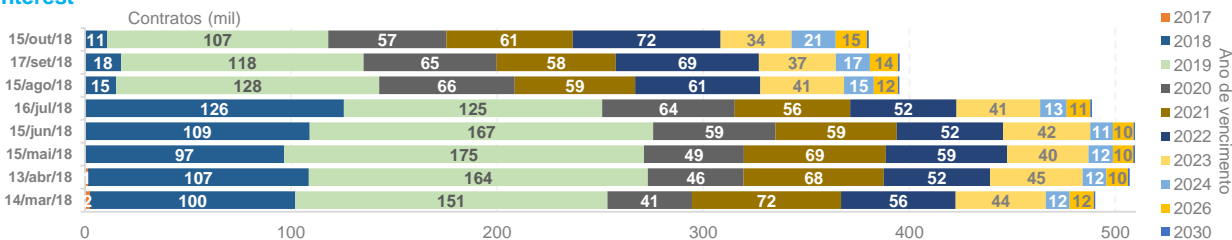
**Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados (desde 15/fev/18)



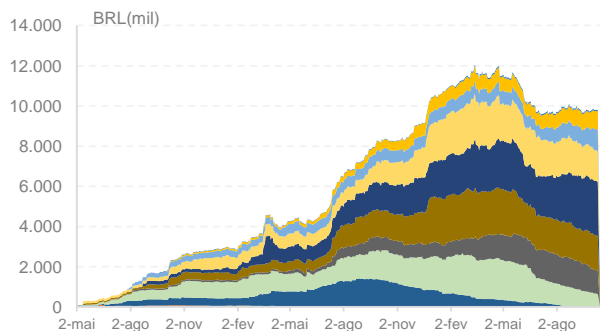
Open Interest



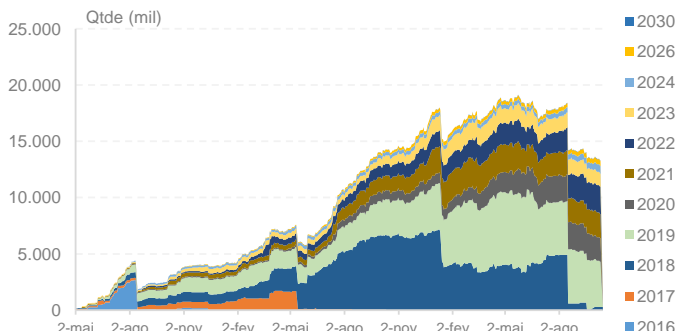
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



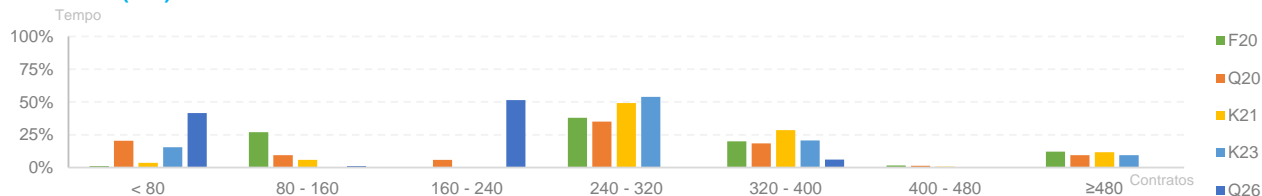
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

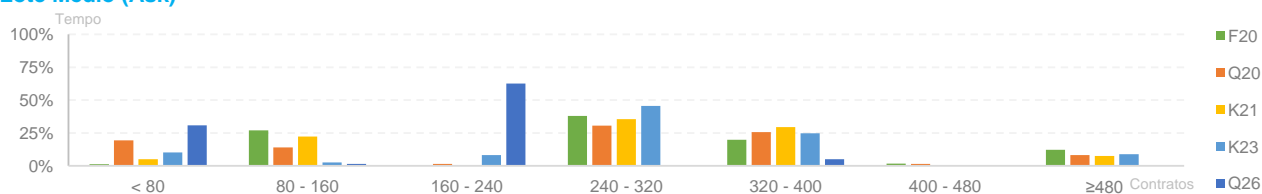
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/20 (F20), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), MAI/23 (K23) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 300 contratos (F20, Q20, K21 e K23) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 10 bps (Q20, K21 e K23), 12 bps (F20) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam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

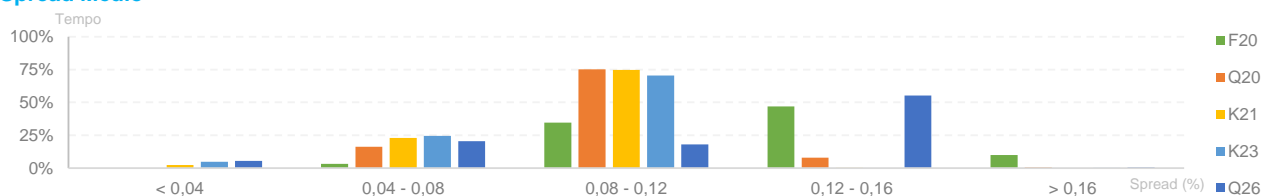
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

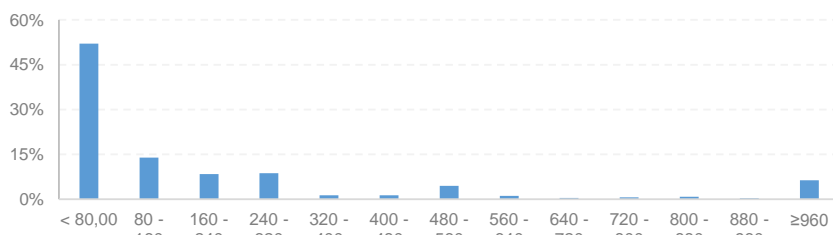


Spread Médio

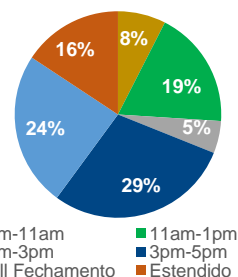


Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

Por Lote Executado

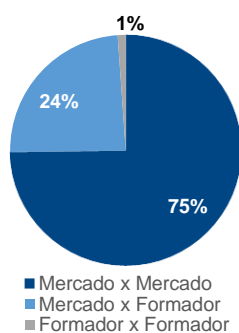


Por Janelas de Negociação

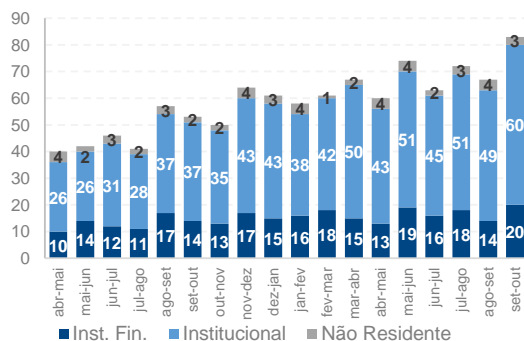


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

