

## Informações Contratos Disponíveis

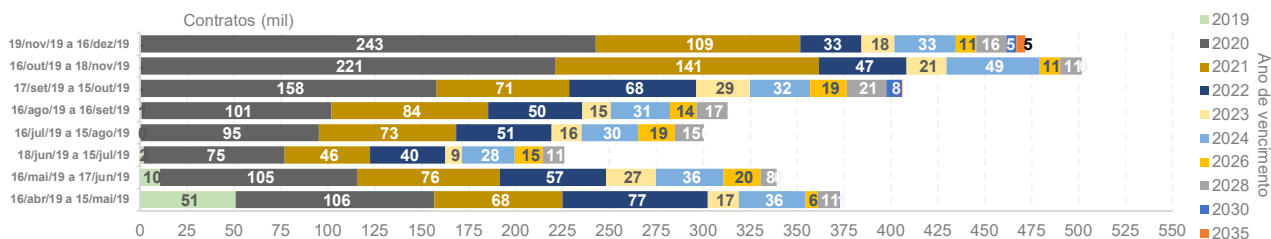
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPF20	WLF0 Index	15/01/2020	20	-7,25%	100.599,11	1,13	0,64%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPG20	WLG20 Index	17/02/2020	43	-2,48%	100.429,43	2,31	0,74%	
Tick Size	0,01%	DAPH20	WLH20 Index	16/03/2020	61	-2,20%	100.539,94	3,27	0,80%	
Lote padrão	5	DAPK20	WLK20 Index	15/05/2020	102	-1,35%	100.551,67	5,42	0,99%	
Informações de Mercado		DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	167	-0,30%	100.199,31	8,76	1,38%	
Data	16/12/2019	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	271	0,25%	99.731,85	14,07	1,98%	
DI	4,40%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	353	0,54%	99.248,44	18,18	2,30%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	668	1,46%	96.230,70	33,05	3,56%	
Data início	18/11/2019	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	854	1,81%	94.102,05	41,18	4,39%	
Data fim	16/12/2019	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.170	2,26%	90.144,12	53,80	5,57%	
DU Mês Total	20	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.675	2,72%	83.662,57	71,16	7,46%	
Índice Inflação Inicial	5.233,07	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.176	3,08%	76.955,56	84,73	9,28%	
1ª Prêvia IPCA	07/11/2019	0,40%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.676	3,28%	70.984,09	95,92	11,06%
2ª Prêvia IPCA	22/11/2019	0,42%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.869	3,48%	59.143,47	115,30	15,73%
IPCA IBGE	06/12/2019	0,51%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.259,76									

\*Por contrato

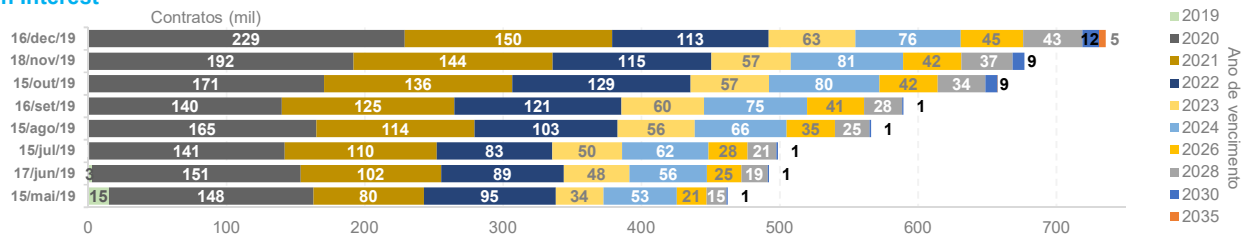
\*\*Margem Teórica Máxima em % do PU

## Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

### Contratos Negociados



### Open Interest

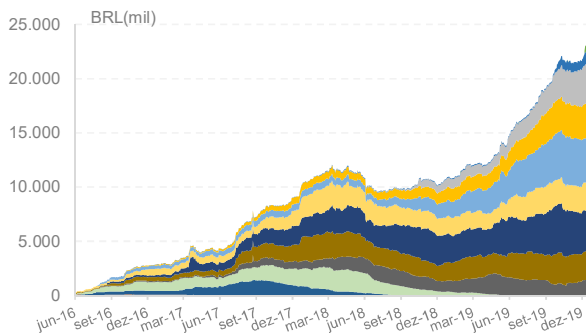


### ADV (Contratos)

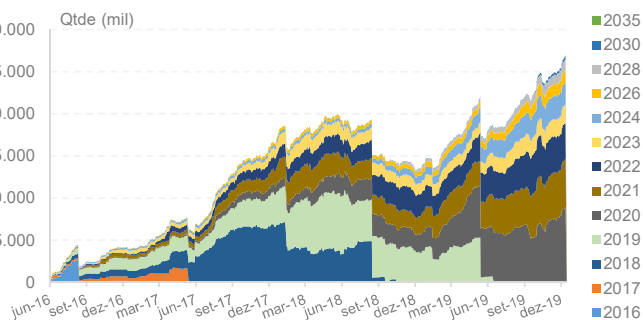


18/fev/19 a 15/mar/19    18/mar/19 a 15/abr/19    16/abr/19 a 15/mai/19    16/mai/19 a 17/jun/19    18/jun/19 a 15/jul/19    16/jul/19 a 15/ago/19    16/ago/19 a 16/set/19    17/set/19 a 15/out/19    16/out/19 a 18/nov/19    19/nov/19 a 16/dez/19

### Open Interest em DV01 Equivalente



### Open Interest em NTN-B Equivalente



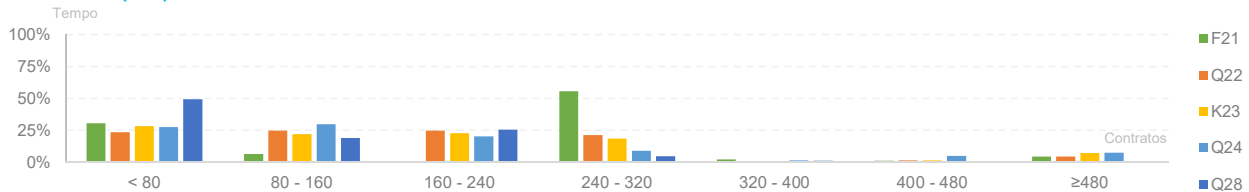
## Programa de Formador de Mercado

### Obrigações do Formador de Mercado

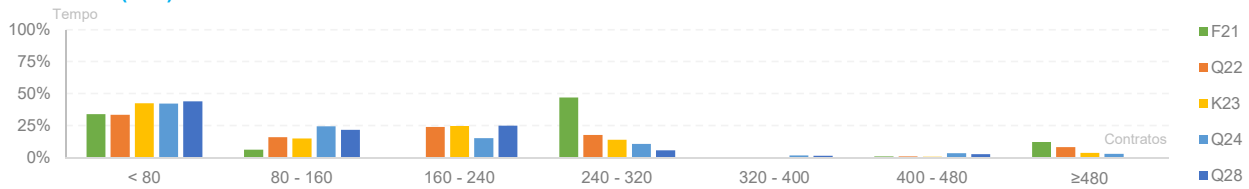
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/21 (F21), AGO/22 (Q22), MAI/23 (K23), AGO/24 (Q24) e AGO/28 (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo A*: 300 contratos (F21, Q22, K23 e Q24) e 160 contratos (Q28) na compra e na venda
- Spread Máximo *Modelo A*: 10 bps (F21, Q22, K23 e Q24) e 15 bps (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo B*: 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

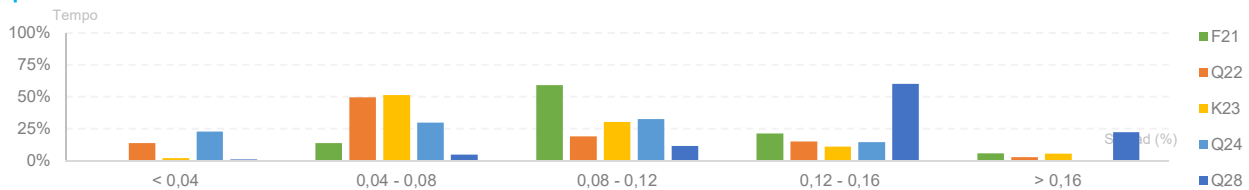
### Lote Médio (Bid)



### Lote Médio (Ask)

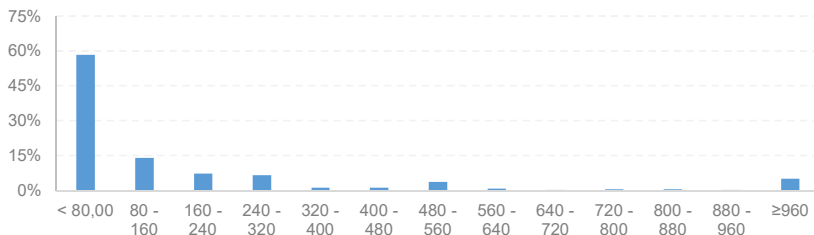


### Spread Médio

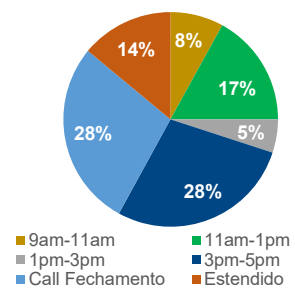


## Frequência de Execução de Ordens

### Por Lote Executado

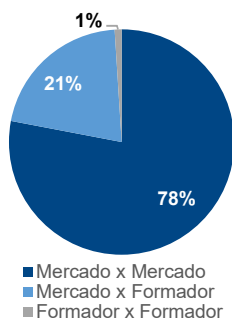


## Por Janelas de Negociação

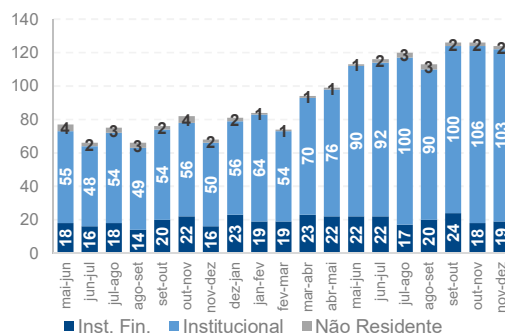


## Participação por Tipo de Investidor

### Breakdown Participação FM



### Número de Instituições Negociando DAP



## Negociação em Tela

### Diretos Intencionais

