

CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

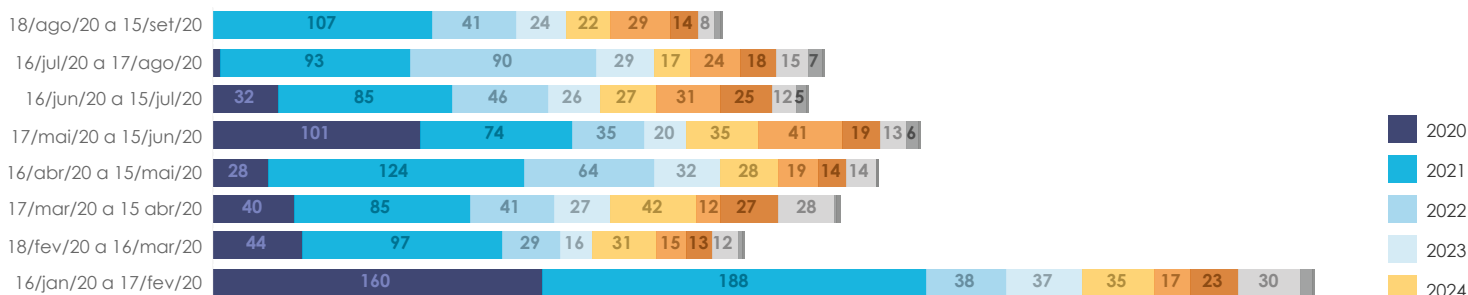
1. Informações dos Contratos Disponíveis

| ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO | | Código B3 | Código Bbg | Vencimento | DU | Taxa | PU | BPV* | Margem** |
|----------------------------------|--------------------|-----------|-------------|------------|------|--------|---------|--------|----------|
| PU DO CONTRATO (PONTOS) | 100.000 | DAPV20 | WLV20 Index | 15/10/2020 | 20 | -1,64% | 100.131 | 1,08 | 0,69% |
| VALOR DO PONTO (BRL) | 0,00025 | DAPX20 | WLX20 Index | 16/11/2020 | 41 | -2,41% | 100.398 | 2,24 | 0,71% |
| TICK SIZE | 0,01% | DAPZ20 | WLZ20 Index | 15/12/2020 | 62 | -2,37% | 100.592 | 3,39 | 0,84% |
| LOTE PADRÃO | 5 | DAPF21 | WLF21 Index | 15/01/2021 | 83 | -2,62% | 100.878 | 4,56 | 0,93% |
| INFORMAÇÕES DE MERCADO | | DAPK21 | WLK21 Index | 17/05/2021 | 165 | -1,98% | 101.318 | 9,04 | 1,38% |
| DATA | 16/09/2020 | DAPF22 | WLF22 Index | 17/01/2022 | 335 | -0,96% | 101.291 | 18,16 | 2,28% |
| DI | 1,90% | DAPQ22 | WLQ22 Index | 15/08/2022 | 480 | -0,26% | 100.497 | 25,64 | 2,69% |
| DADOS DE INFLAÇÃO | | DAPK23 | WLK23 Index | 15/05/2023 | 666 | 0,29% | 99.238 | 34,93 | 3,62% |
| DATA INÍCIO | 18/08/2020 | DAPQ24 | WLQ24 Index | 15/08/2024 | 982 | 1,49% | 94.400 | 48,41 | 4,92% |
| DATA FIM | 15/09/2020 | DAPK25 | WLK25 Index | 15/05/2025 | 1169 | 1,90% | 91.639 | 55,72 | 5,58% |
| DU MÊS TOTAL | 22 | DAPQ26 | WLQ26 Index | 17/08/2026 | 1487 | 2,51% | 86.391 | 66,42 | 6,78% |
| ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL | 5.344,63 | DAPQ28 | WLQ28 Index | 15/08/2028 | 1988 | 3,02% | 79.079 | 80,87 | 8,65% |
| 1ª PRÉVIA IPCA | 07/08/2020 0,12% | DAPQ30 | WLQ30 Index | 15/08/2030 | 2488 | 3,50% | 71.202 | 90,69 | 10,33% |
| 2ª PRÉVIA IPCA | 25/08/2020 0,21% | DAPK35 | WLK35 Index | 15/05/2035 | 3681 | 3,89% | 57.267 | 107,49 | 14,71% |
| IPCA IBGE | 09/09/2020 0,24% | | | | | | | | |
| ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO | 5.357,46 | | | | | | | | |

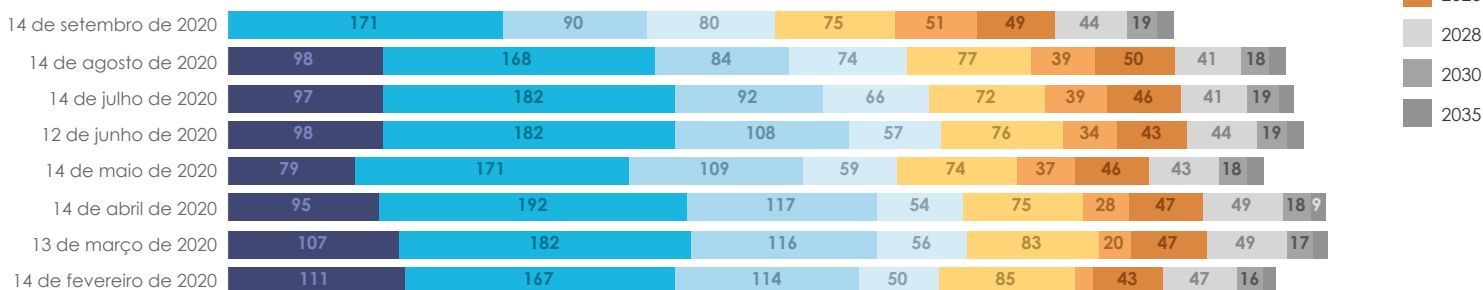
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

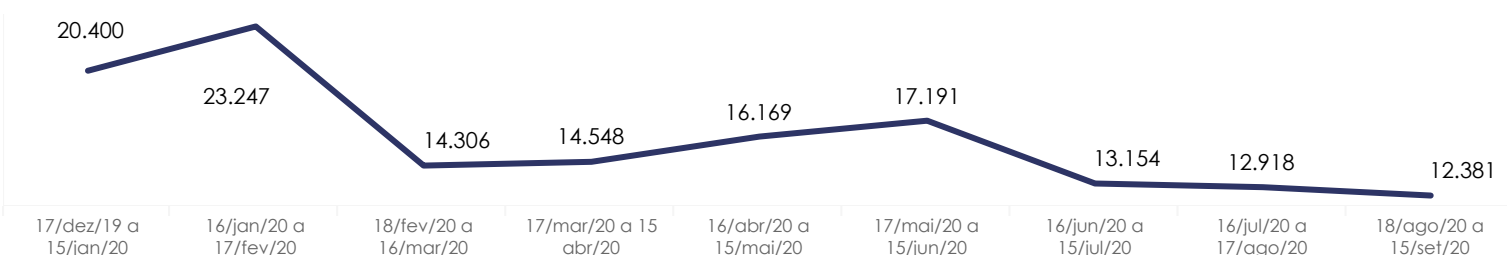
Contratos Negociados (em Milhares)



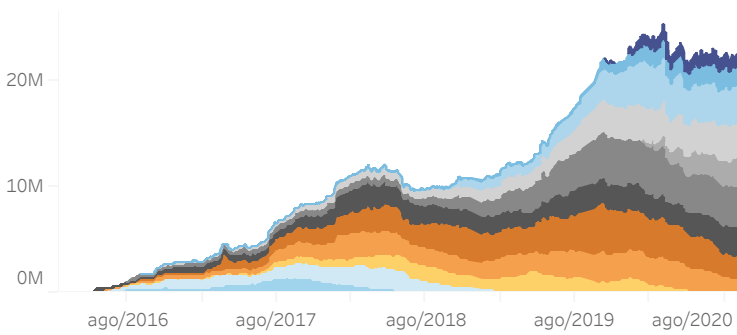
Open Interest (em Milhares)



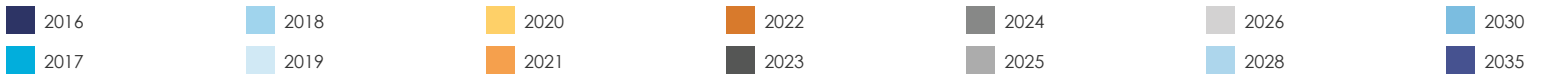
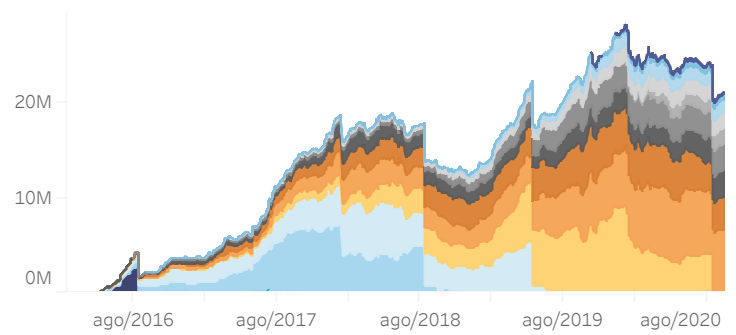
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



3. Programa de Formador de Mercado

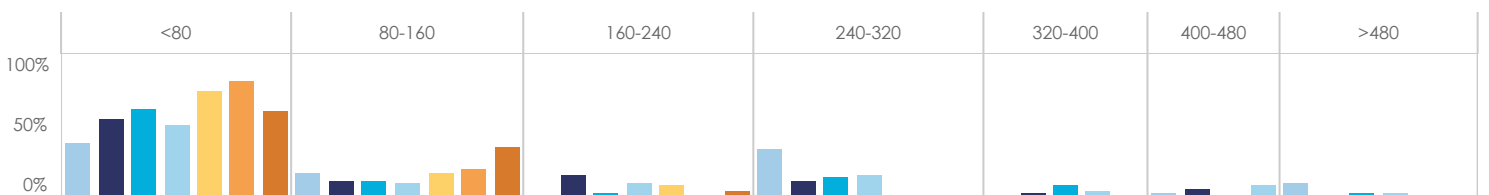
Obrigações do Formador de Mercado

| FORMADOR DE MERCADO | | PERÍODO DE ATUAÇÃO | VENCIMENTOS | MODELO A | | MODELO B | | | | HORÁRIOS |
|---------------------|-------------|-------------------------|-------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|---------------|-------------------|---|
| MODELO A | MODELO B | | | CAMADA 1 | | CAMADA 1* | | CAMADA 2* | | |
| | | | | SPREAD MÁXIMO | QUANTIDADE MÍNIMA | SPREAD MÁXIMO | QUANTIDADE MÍNIMA | SPREAD MÁXIMO | QUANTIDADE MÍNIMA | |
| Itaú Santander | Mercury TMG | 02/05/2020 a 14/07/2020 | jan/21 | 14 bps | 300 | 12 bps | 120 | 5 bps | 10 | Formadores 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) |
| | | | | 20 bps | | | | 7 bps | | |
| | | 15/07/2020 a 14/09/2020 | jan/22 | 10 bps | | 8 bps | 3 bps | | | |
| | | | | 14 bps | | 12 bps | 5 bps | | | |
| | | 02/05/2020 a 30/04/2021 | mai/23 | 10 bps | | 6 bps | 80 | 3 bps | | |
| | | | ago/24 | | | 60 | | | | |
| | | | mai/25 | | | 60 | | | | |
| | | | ago/26 | | | 50 | | | | |
| ago/28 | 15 bps | 60 | 15 bps | 40 | 4 bps | | | | | |
| ago/30 | 100 | 13 bps | 5 bps | 5 | | | | | | |

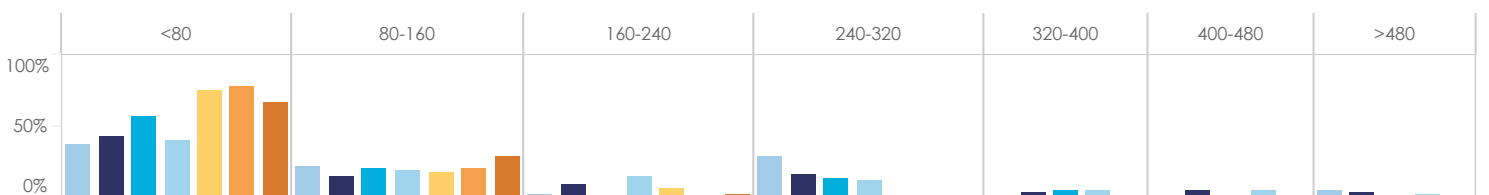
4. Vencimentos Mais Líquidos

Informações do Topo do Livro (18/08 a 15/09)

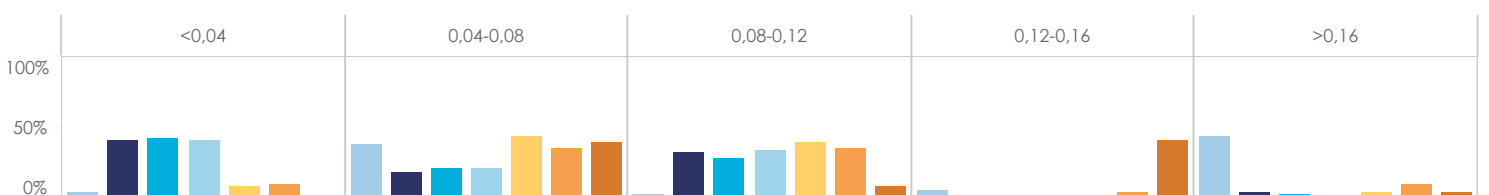
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

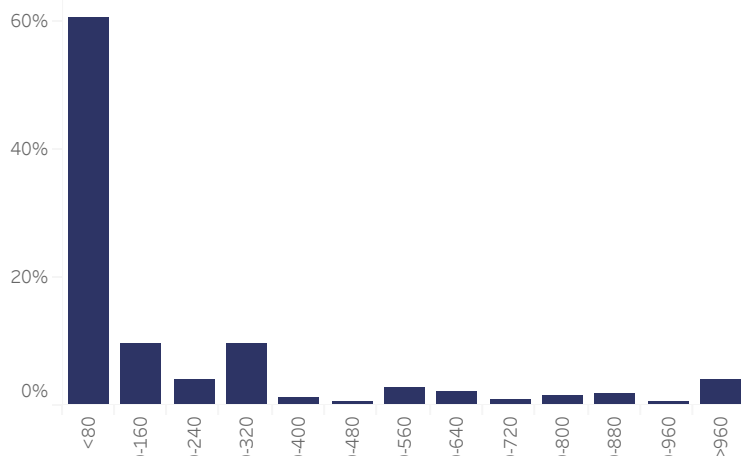


Spread Médio

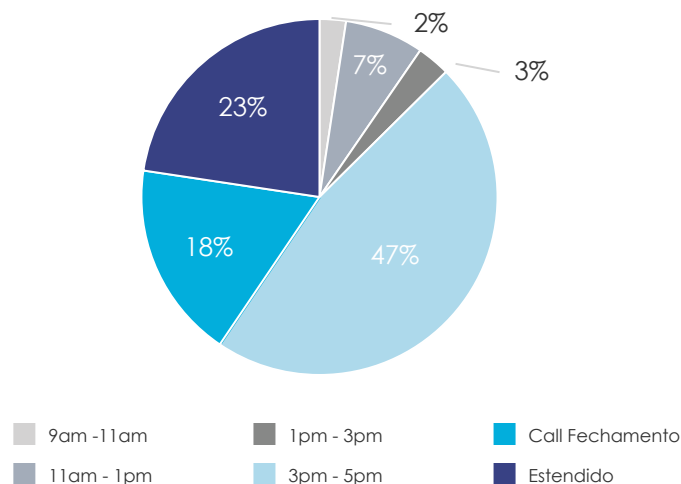


5. Frequência de Execução das Ordens

Por Lote Executado

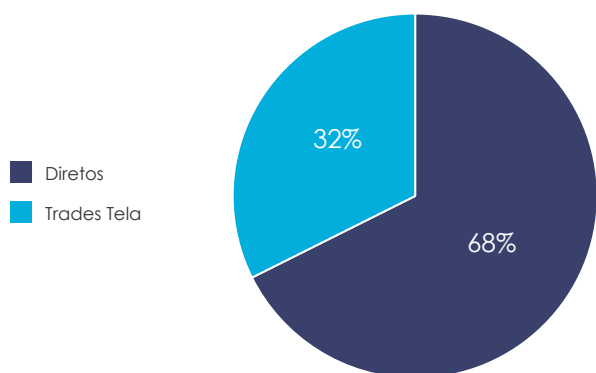


Por Janela de Negociação



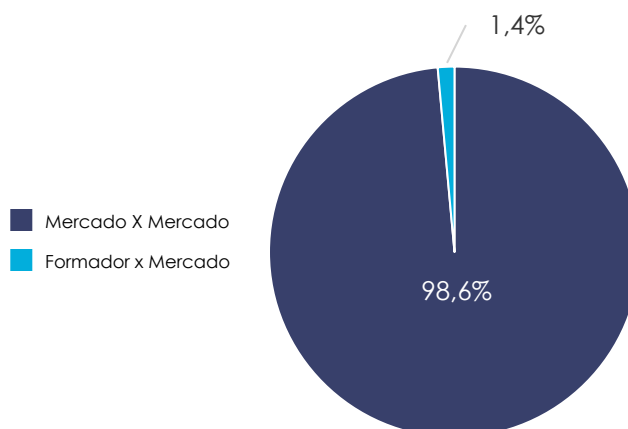
6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

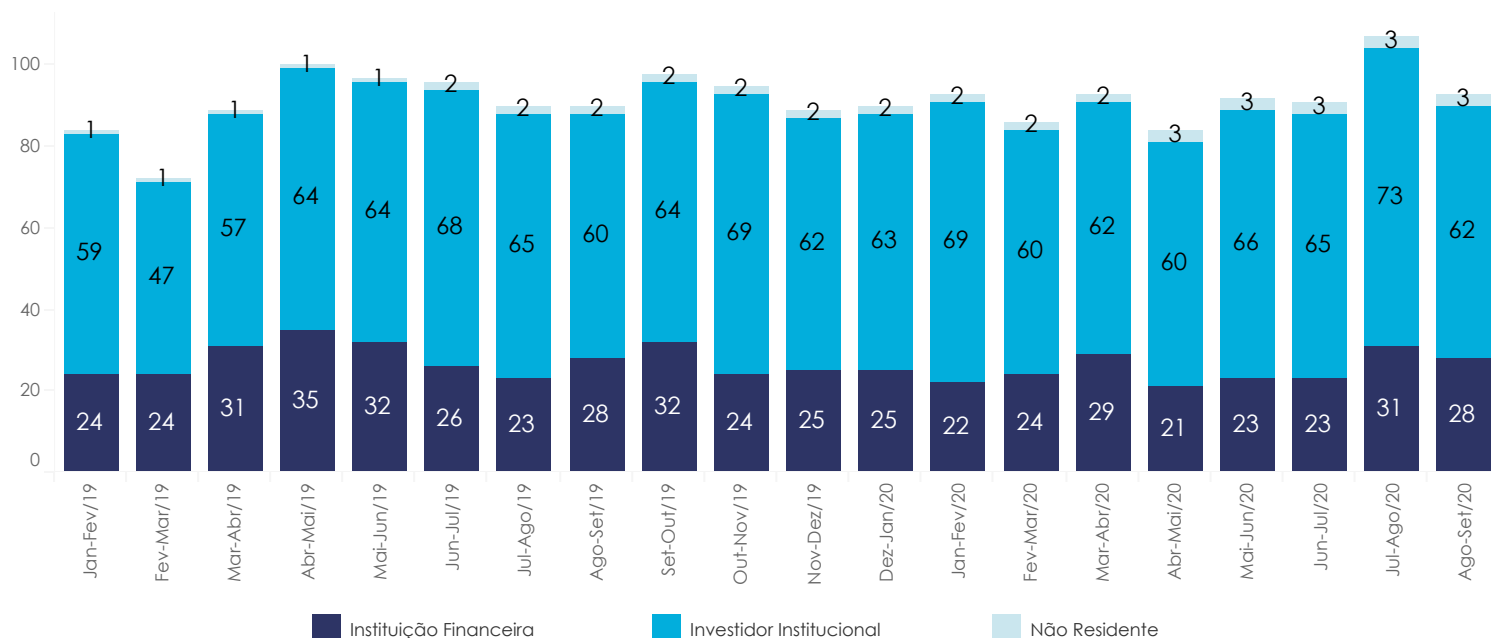


7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



8. Número de Instituições Negociando DAP



Contate-nos

B3 clientes CLIENTES.B3.COM.BR
Institucional B3.COM.BR