

Informações Contratos Disponíveis

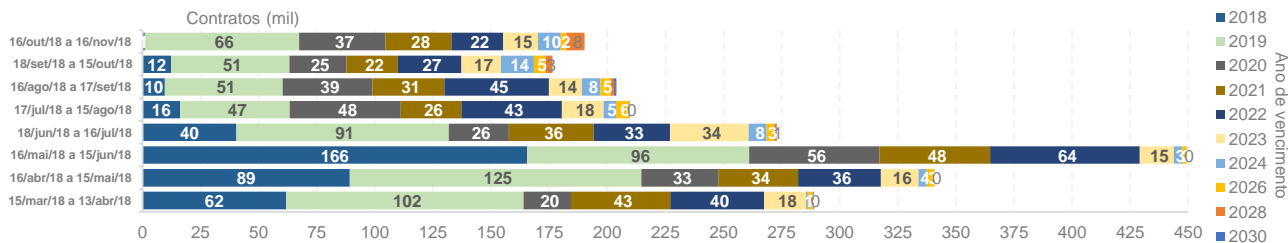
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	DV01*	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPZ18	WLZ8 Index	17/12/2018	21	6,71%	99.460,26	0,99	0,52%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPF19	WLF9 Index	15/01/2019	40	5,75%	99.116,50	1,90	0,56%	
Tick Size	0,01%	DAPG19	WLG9 Index	15/02/2019	63	4,25%	98.964,85	3,03	0,56%	
Lote padrão	5	DAPK19	WLK9 Index	15/05/2019	122	3,03%	98.565,27	5,91	0,69%	
Informações de Mercado		DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	293	3,13%	96.479,99	13,88	1,67%	
Data	16/11/2018	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	440	3,45%	94.249,72	20,29	2,22%	
DI	6,40%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	626	3,86%	91.020,72	27,77	3,08%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	941	4,45%	84.995,02	38,76	4,26%	
Data início	15/10/2018	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.127	4,62%	81.710,64	44,56	4,86%	
Data fim	16/11/2018	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.443	4,78%	76.538,87	53,35	5,93%	
DU Mês Total	22	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.948	5,03%	68.429,65	64,23	7,86%	
Índice Inflação Inicial	5.080,83	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.449	5,07%	61.839,25	72,94	9,80%	
1ª Prévia IPCA	05/10/2018	0,49%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.949	4,96%	56.750,70	80,68	11,53%
2ª Prévia IPCA	23/10/2018	0,54%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	4.142	5,13%	43.942,98	87,59	15,95%
IPCA IBGE	10/11/2018	0,45%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.103,69									

*Por contrato

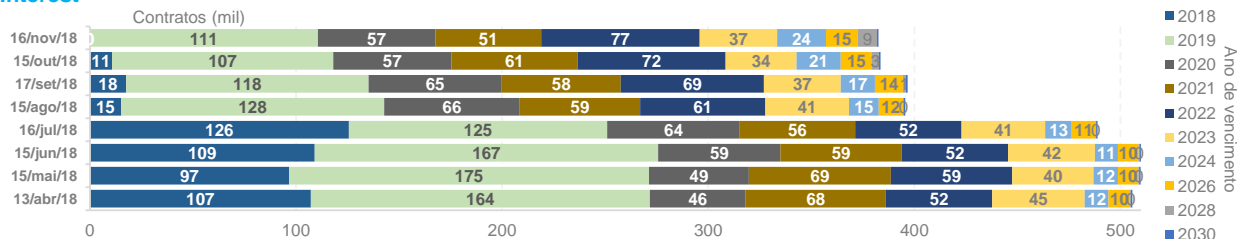
**Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



Open Interest

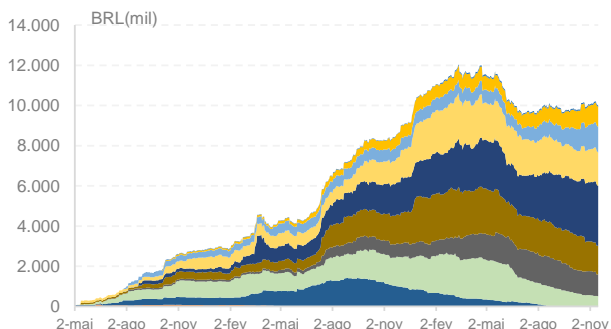


ADV (Contratos)

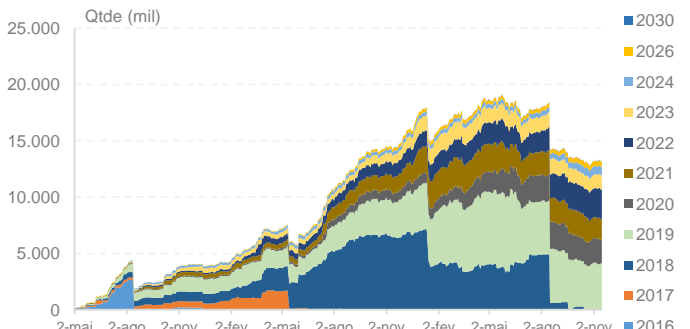


15/jan/18 a 14/fev/18 15/fev/18 a 14/mar/18 15/mar/18 a 13/abr/18 16/abr/18 a 15/mai/18 16/mai/18 a 15/jun/18 18/jun/18 a 16/jul/18 17/jul/18 a 15/ago/18 16/ago/18 a 17/set/18 18/set/18 a 15/out/18 16/out/18 a 16/nov/18

Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



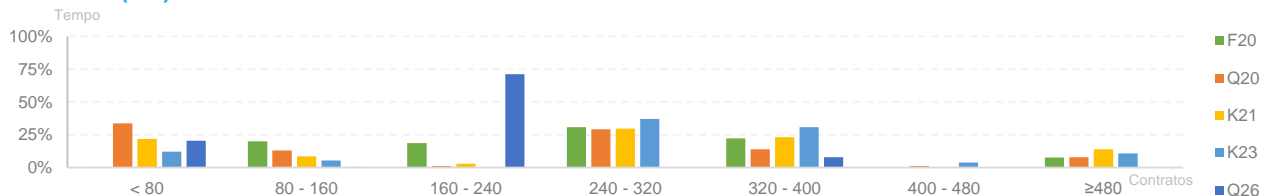
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

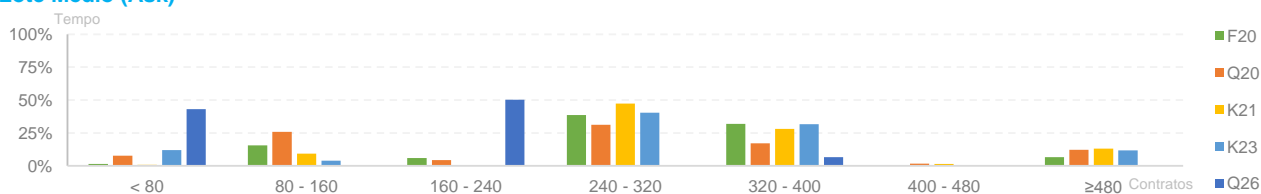
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/20 (F20), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), MAI/23 (K23) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 300 contratos (F20, Q20, K21 e K23) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 10 bps (Q20, K21 e K23), 12 bps (F20) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam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

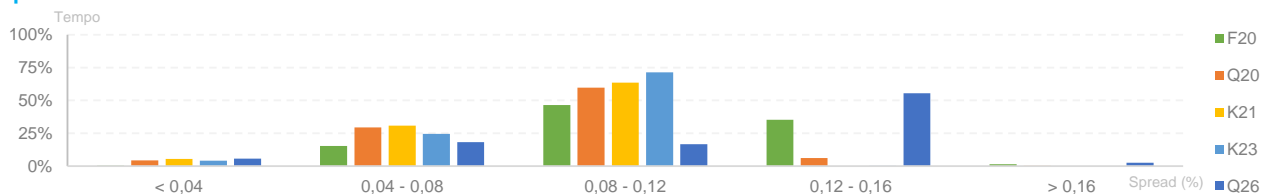
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

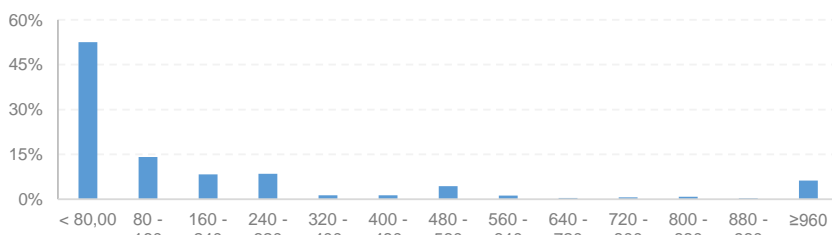


Spread Médio

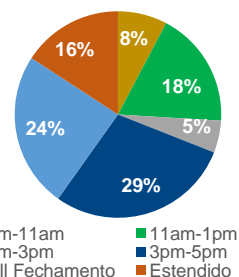


Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

Por Lote Executado

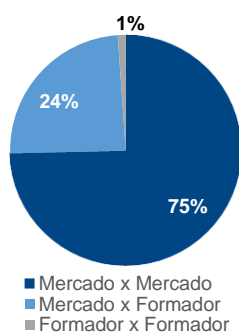


Por Janelas de Negociação

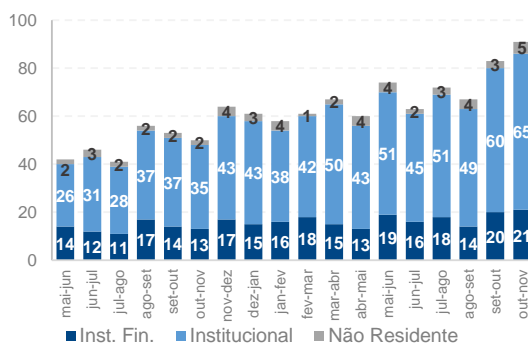


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

