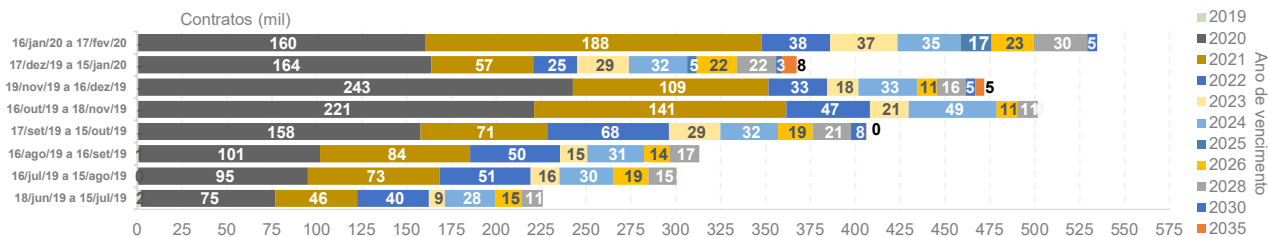


## Informações Contratos Disponíveis

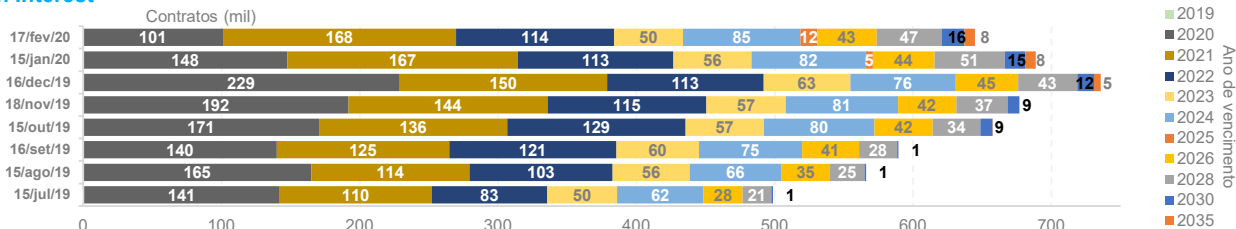
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPH20	WLH20 Index	16/03/2020	18	2,29%	99.838,40	0,93	0,73%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPJ20	WLJ20 Index	15/04/2020	39	2,15%	99.671,33	2,01	0,82%	
Tick Size	0,01%	DAPK20	WLK20 Index	15/05/2020	59	1,71%	99.603,81	3,06	0,92%	
Lote padrão	5	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	124	1,12%	99.453,45	6,45	1,24%	
Informações de Mercado		DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	228	0,89%	99.201,53	11,86	1,87%	
Data	17/02/2020	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	310	0,88%	98.927,98	16,08	2,21%	
DI	4,15%	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	480	1,27%	97.624,85	24,47	2,67%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	625	1,48%	96.421,85	31,40	3,44%	
Data início	15/01/2020	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	811	1,75%	94.569,77	39,86	4,28%	
Data fim	17/02/2020	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.127	2,16%	90.885,34	53,02	5,46%	
DU Mês Total	23	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1.314	2,37%	88.502,72	60,07	6,14%	
Índice Inflação Inicial	5.320,25	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.632	2,57%	84.845,75	71,38	7,30%	
1ª Prévía IPCA	10/01/2020	0,32%	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.133	2,86%	78.766,57	86,35	9,04%
2ª Prévía IPCA	23/01/2020	0,34%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.633	3,15%	72.321,58	97,59	10,78%
IPCA IBGE	07/02/2020	0,21%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.826	3,44%	59.839,93	116,97	15,33%
Índice Pro-Rata Calculado	5.331,42	*Por contrato		**Margem Teórica Máxima em % do PU						

## Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

### Contratos Negociados



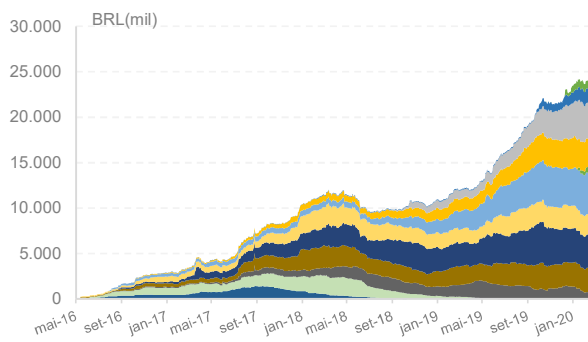
### Open Interest



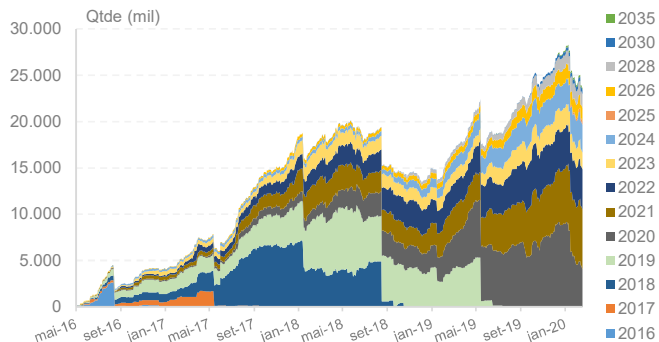
### ADV (Contratos)



### Open Interest em DV01 Equivalente



### Open Interest em NTN-B Equivalente



Atualização: 17/fevereiro/20

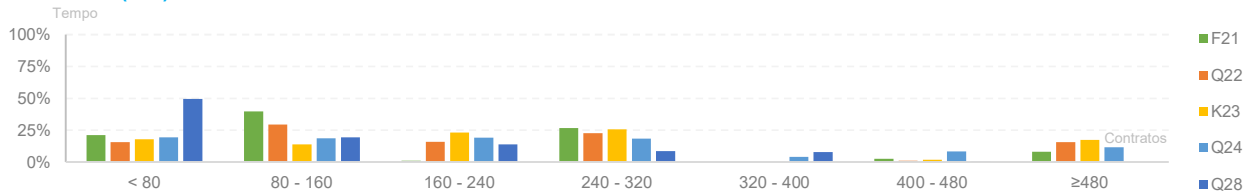
## Programa de Formador de Mercado

### Obrigações do Formador de Mercado

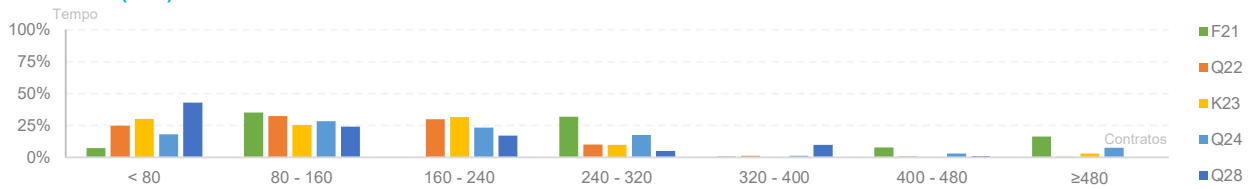
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/21 (F21), AGO/22 (Q22), MAI/23 (K23), AGO/24 (Q24) e AGO/28 (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo A*: 300 contratos (F21, Q22, K23 e Q24) e 160 contratos (Q28) na compra e na venda
- Spread Máximo *Modelo A*: 10 bps (F21, Q22, K23 e Q24) e 15 bps (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo B*: 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 Fevereiro/20

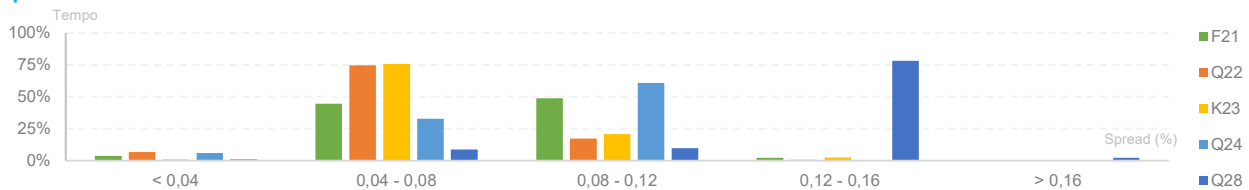
### Lote Médio (Bid)



### Lote Médio (Ask)

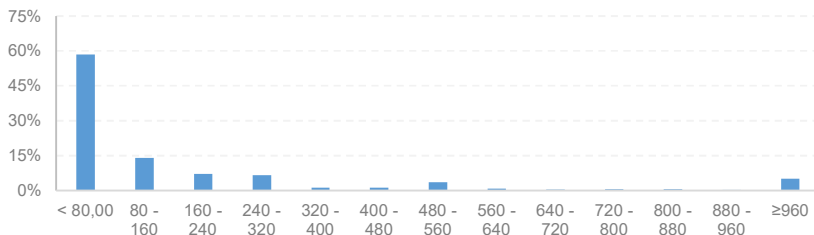


### Spread Médio

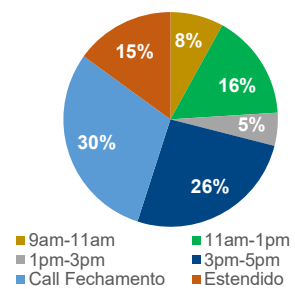


## Frequência de Execução de Ordens

### Por Lote Executado

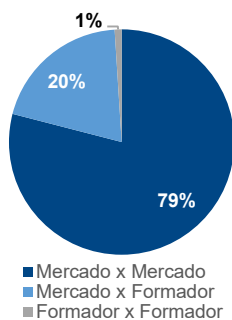


## Por Janelas de Negociação

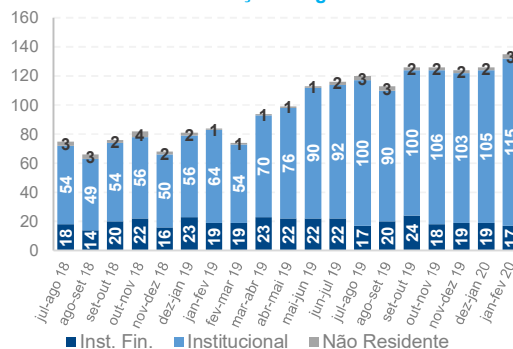


## Participação por Tipo de Investidor

### Breakdown Participação FM



### Número de Instituições Negociando DAP



## Negociação em Tela

### Diretos Intencionais

