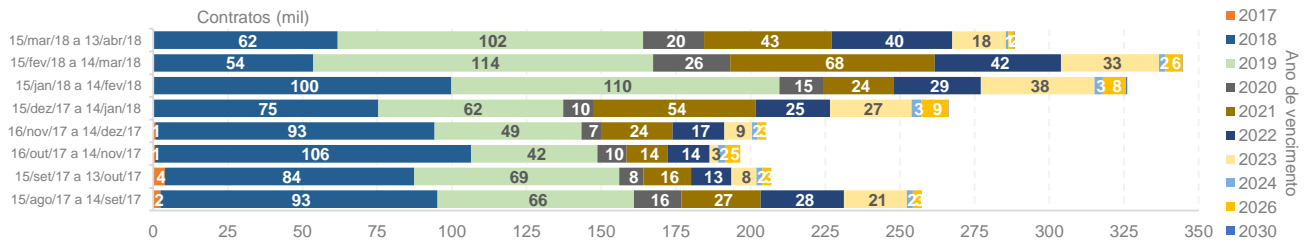


Informações Contratos Disponíveis

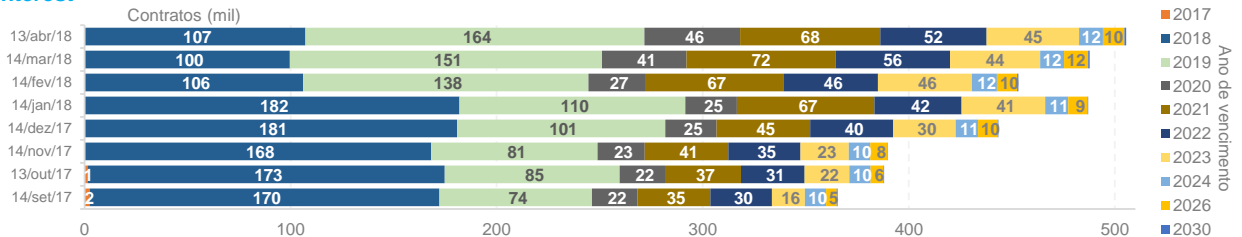
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	DV01*	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPK18	WLK8 Index	15/05/2018	20	2,28%	99.821,24	0,96	0,57%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPM18	WLM8 Index	15/06/2018	42	1,83%	99.698,21	2,02	0,56%	
Tick Size	0,01%	DAPN18	WLN8 Index	16/07/2018	63	2,20%	99.457,44	3,01	0,56%	
Lote padrão	5	DAPQ18	WLQ8 Index	15/08/2018	85	2,56%	99.151,00	4,04	0,60%	
Informações de Mercado		DAPF19	WLF9 Index	15/01/2019	188	2,45%	98.210,46	8,85	1,16%	
Data	16/04/2018	DAPK19	WLK9 Index	15/05/2019	270	2,10%	97.797,91	12,70	1,80%	
DI	6,39%	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	588	3,17%	92.976,96	26,02	2,98%	
Dados de Inflação		DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	774	3,55%	89.839,54	32,98	3,74%	
Data início	15/03/2018	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	1.089	4,21%	83.676,95	42,94	4,84%	
Data fim	16/04/2018	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.275	4,38%	80.501,76	48,28	5,35%	
DU Mês Total	21	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.591	4,58%	75.372,20	56,30	6,52%	
Índice Inflação Inicial	4.946,50	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	2.096	4,76%	67.924,24	66,72	8,40%	
1ª Prévia IPCA	09/03/2018	0,14%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	3.097	5,06%	54.518,16	78,89	12,16%
2ª Prévia IPCA	23/03/2018	0,13%								
IPCA IBGE	09/04/2018	0,09%								
Índice Pro-Rata Calculado	4.950,95									

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados (desde 15/Ago/2017)



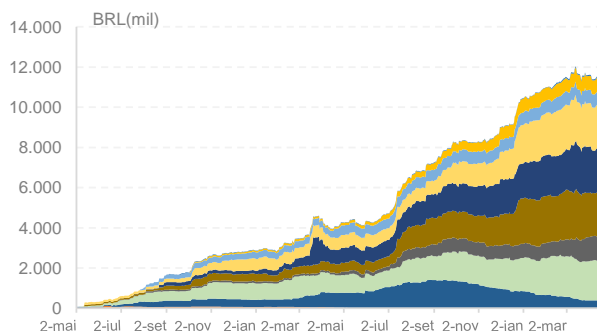
Open Interest



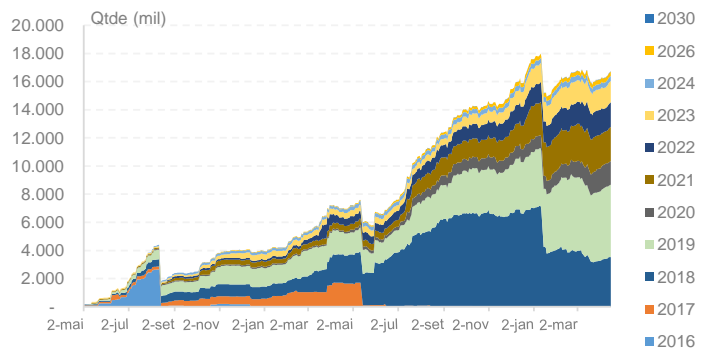
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



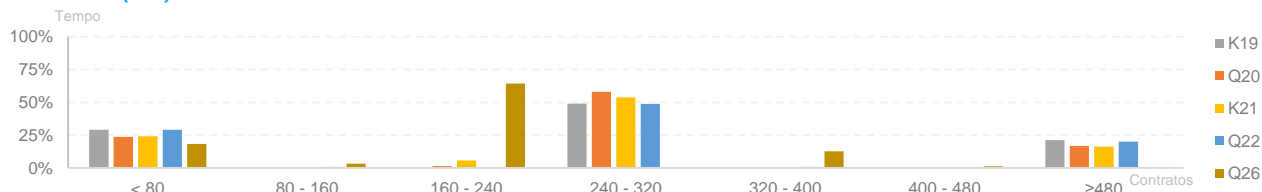
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

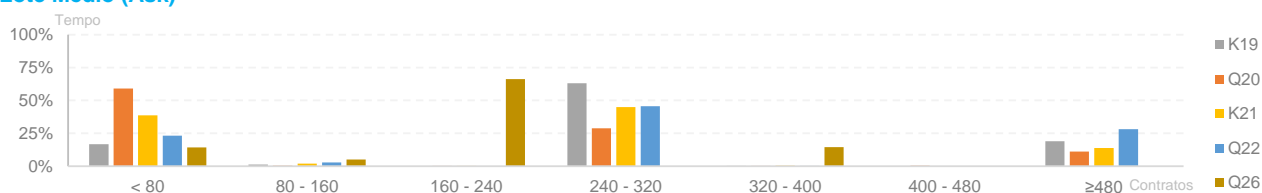
- Vencimentos Obrigatórios: MAI/19 (K19), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), AGO/22 (Q22) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 260 contratos (K19, Q20, K21 e Q22) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 10 bps (K19, Q20, K21 e Q22) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam em 80% do período de 10.30am a 12.00 e 2.20pm a 4.50pm

Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro em Março/18

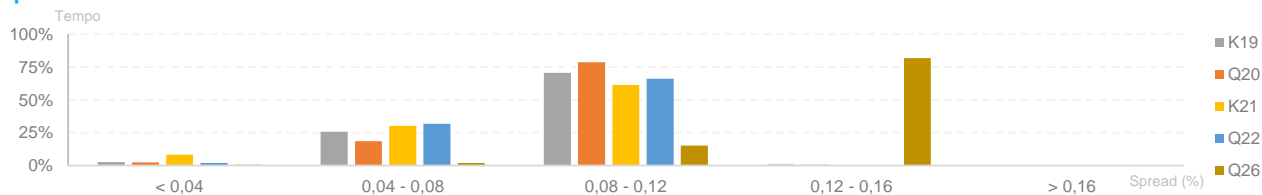
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

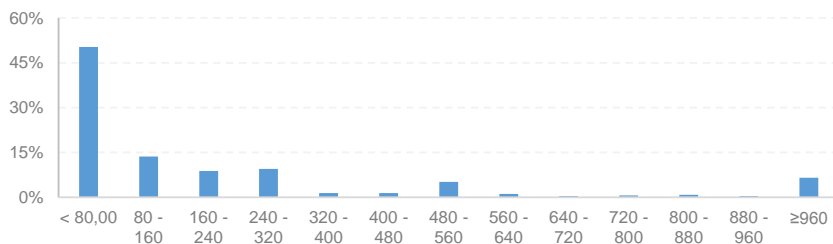


Spread Médio

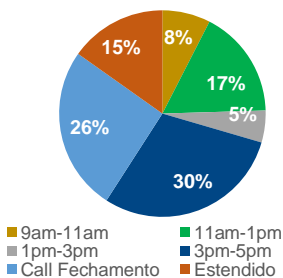


Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

Por Lote Executado

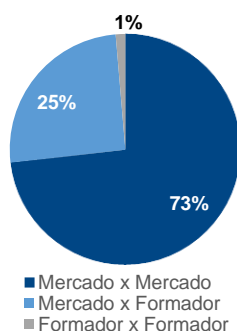


Por Janelas de Negociação

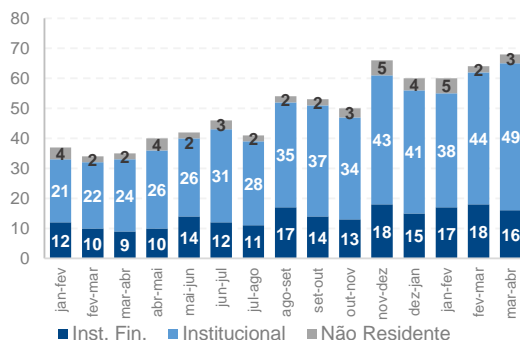


Participação por Tipo de Investidor - Desde Maio/16

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

