

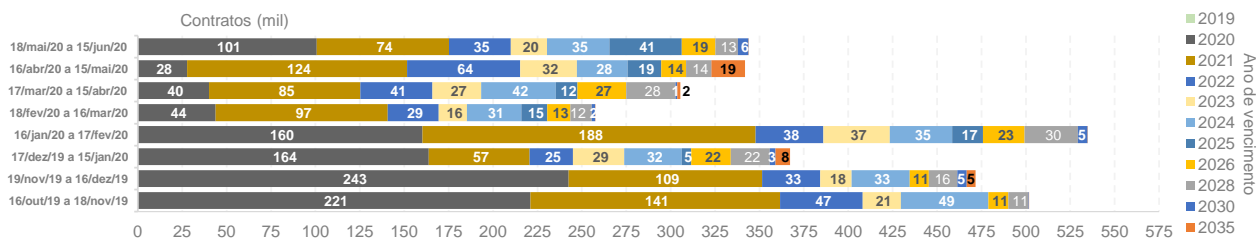
Informações Contratos Disponíveis

Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPN20	WLN20 Index	15/07/2020	22	0,83%	99.927,86	1,15	0,70%
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPQ20	WLU20 Index	17/08/2020	45	-0,18%	100.032,18	2,38	0,74%
Tick Size	0,01%	DAPU20	WLU20 Index	15/09/2020	65	0,03%	99.992,26	3,42	0,85%
Lote padrão	5	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	149	-0,48%	100.284,90	7,91	1,25%
Informações de Mercado									
Data	15/06/2020	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	231	-0,29%	100.266,57	12,24	1,76%
DI	2,90%	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	401	0,17%	99.730,08	21,04	2,47%
Dados de Inflação									
Data início	15/05/2020	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	546	0,85%	98.182,83	28,01	2,89%
Data fim	15/06/2020	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	732	1,16%	96.705,37	36,87	3,91%
DU Mês Total	20	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.048	1,91%	92.433,32	50,08	5,15%
Índice Inflação Inicial	5.331,91	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1.235	2,17%	90.013,57	57,32	5,82%
1ª Prévia IPCA	08/05/2020	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.553	2,65%	85.113,45	67,83	7,03%
2ª Prévia IPCA	26/05/2020	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.054	3,18%	77.479,30	81,24	8,85%
IPCA IBGE	10/06/2020	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.554	3,52%	70.425,56	91,51	10,50%
Índice Pro-Rata Calculado	5.311,65	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.747	4,16%	54.551,09	103,33	15,21%

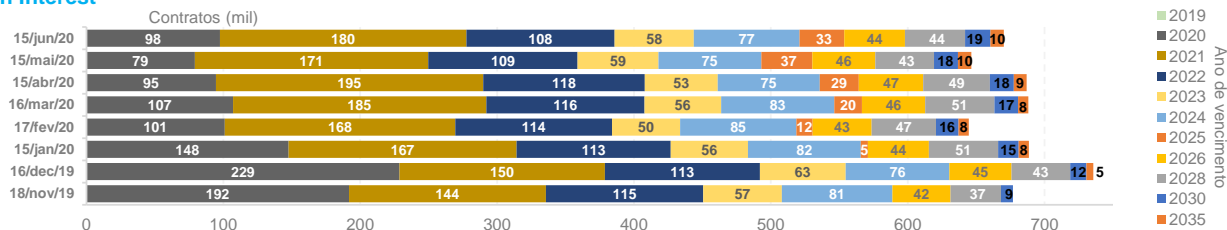
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



Open Interest

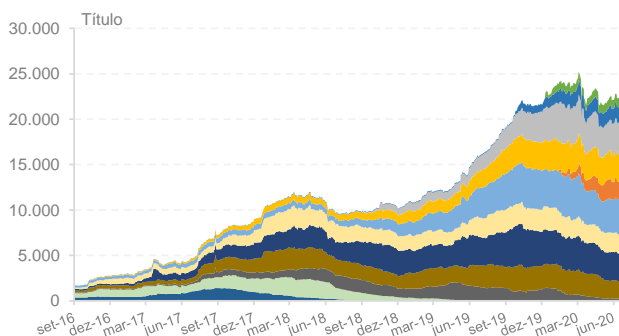


ADV (Contratos)

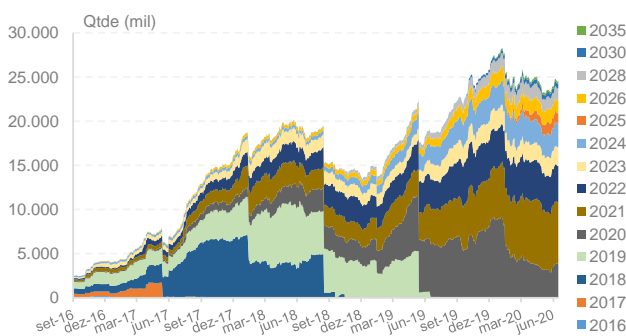


16/jul/19 a 15/ago/19 16/ago/19 a 16/set/19 17/set/19 a 15/out/19 16/out/19 a 18/nov/19 19/nov/19 a 16/dez/19 17/dez/19 a 15/jan/20 16/jan/20 a 17/fev/20 18/fev/20 a 16/mar/20 17/mar/20 a 15/abr/20 16/abr/20 a 15/mai/20 18/mai/20 a 15/jun/20

Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



Atualização: 15/junho/20

Programa de Formador de Mercado

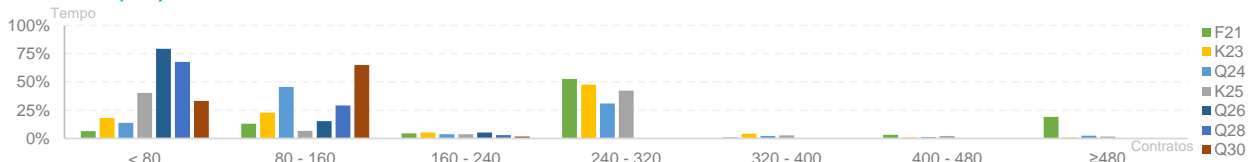
Obrigações do Formador de Mercado

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	
		15/07/2020 a 14/09/2020		20 bps		18 bps		7 bps		
		15/09/2020 a 14/04/2021	jan/22	10 bps		8 bps	3 bps			
		15/04/2021 a 30/04/2021		14 bps		12 bps	5 bps			
		02/05/2020 a 30/04/2021	mai/23	10 bps		6 bps	80	3 bps		
			ago/24	10 bps		6 bps	80	3 bps		
			mai/25	10 bps		240	8 bps	60		3 bps
			ago/26	10 bps		60	8 bps	50		4 bps
			ago/28	15 bps		60	10 bps	40		4 bps
			ago/30	15 bps		100	13 bps	40		5 bps

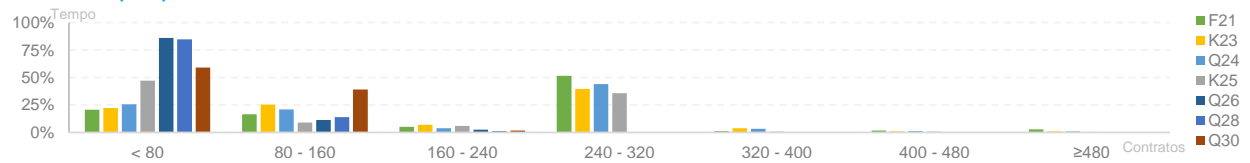
*Atuação simultânea em ambas as camadas

Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro de 18 de Maio a 15 de Junho

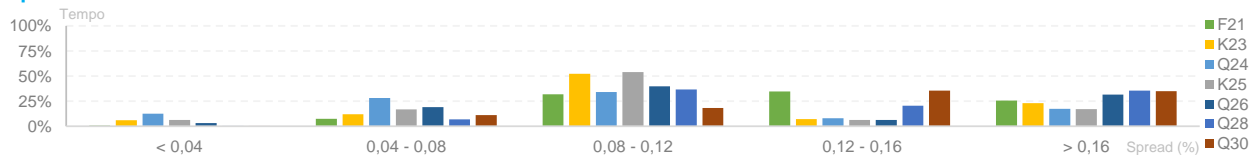
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

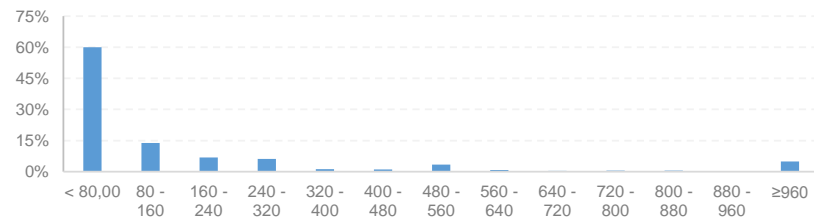


Spread Médio

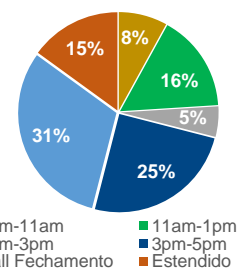


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

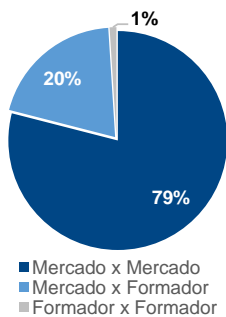


Por Janelas de Negociação

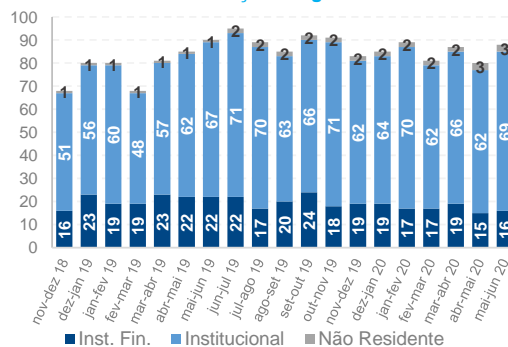


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM

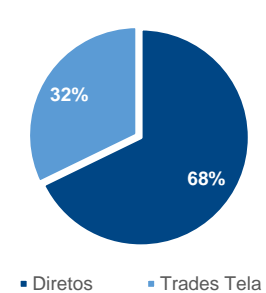


Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais



Atualização: 15/junho/20