

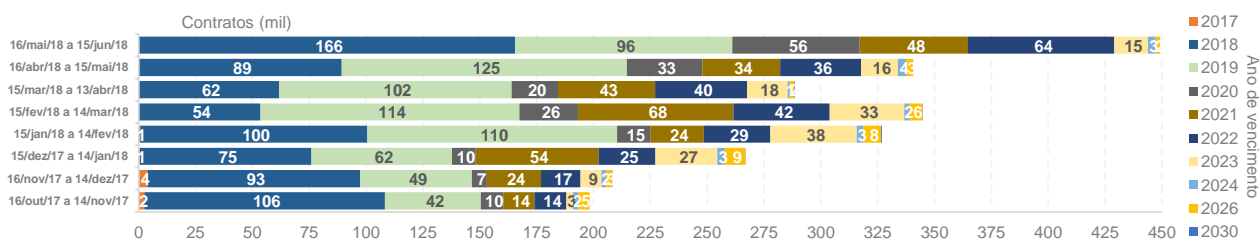
Informações Contratos Disponíveis

Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	DV01*	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPN18	WLN8 Index	16/07/2018	21	-4,34%	100.370,43	1,09	0,63%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPQ18	WLQ8 Index	15/08/2018	43	-1,10%	100.188,92	2,15	0,56%	
Tick Size	0,01%	DAPU18	WLU8 Index	17/09/2018	65	1,16%	99.702,96	3,17	0,55%	
Lote padrão	5	DAPF19	WLF9 Index	15/01/2019	146	2,28%	98.702,37	6,96	0,90%	
Informações de Mercado		DAPK19	WLK9 Index	15/05/2019	228	2,91%	97.438,11	10,67	1,43%	
Data	15/06/2018	DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	399	4,04%	93.921,74	17,80	2,32%	
DI	6,39%	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	546	4,45%	90.997,97	23,51	2,75%	
Dados de Inflação		DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	732	5,05%	86.666,16	29,84	3,50%	
Data início	15/05/2018	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	1.047	5,60%	79.741,07	39,06	4,66%	
Data fim	15/06/2018	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.233	5,64%	76.455,91	44,09	5,23%	
DU Mês Total	22	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.549	5,68%	71.206,63	51,56	6,30%	
Índice Inflação Inicial	4.961,84	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	2.054	5,92%	62.576,27	59,95	8,19%	
1ª Prévía IPCA	10/05/2018	0,37%	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.555	5,97%	55.548,59	66,16	10,04%
2ª Prévía IPCA	23/05/2018	0,23%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	3.055	5,88%	50.024,22	71,29	11,90%
IPCA IBGE	11/06/2018	0,40%								
Índice Pro-Rata Calculado	4.981,69									

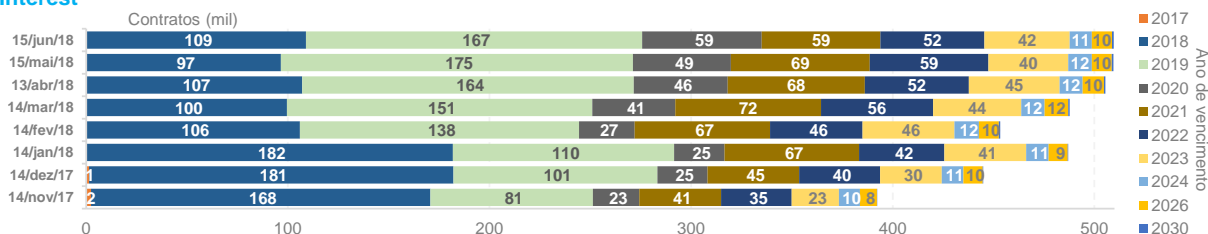
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados (desde 16/out/2017)



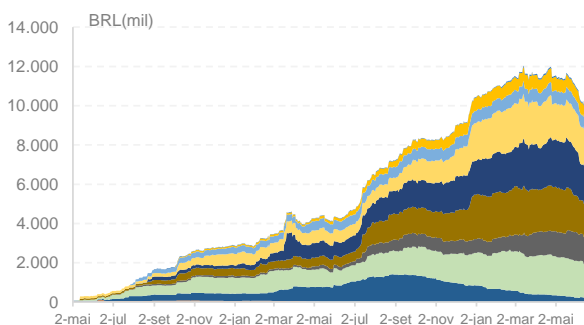
Open Interest



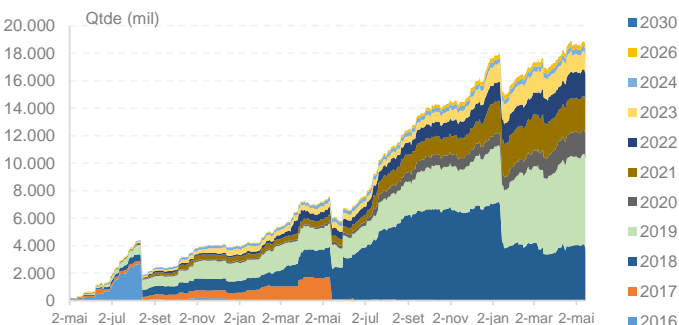
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



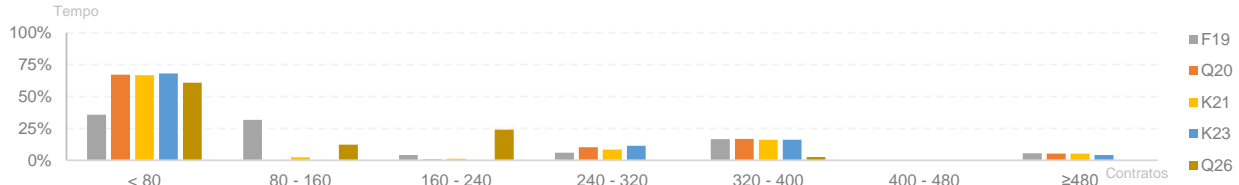
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

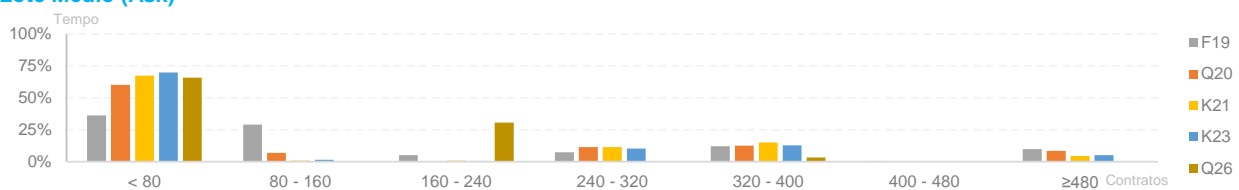
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/19 (F19), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), MAI/23 (K23) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 300 contratos (F19, Q20, K21 e K23) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 16 bps (F19), 10 bps (Q20, K21 e K23) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam 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 Junho/18

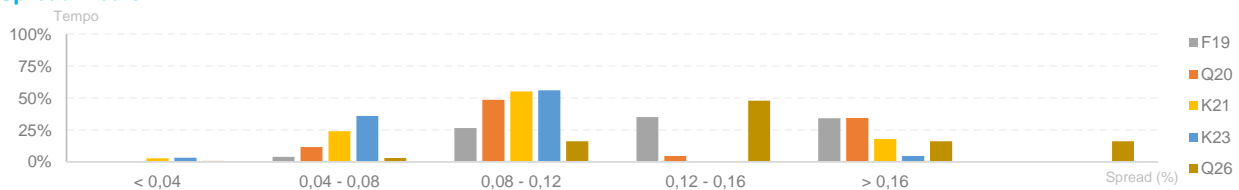
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

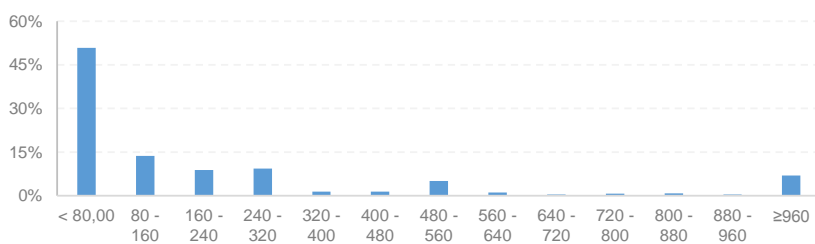


Spread Médio

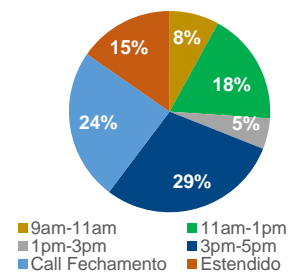


Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

Por Lote Executado

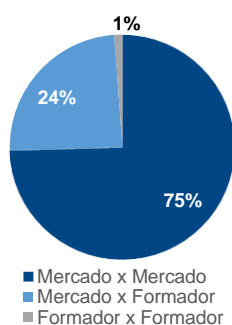


Por Janelas de Negociação

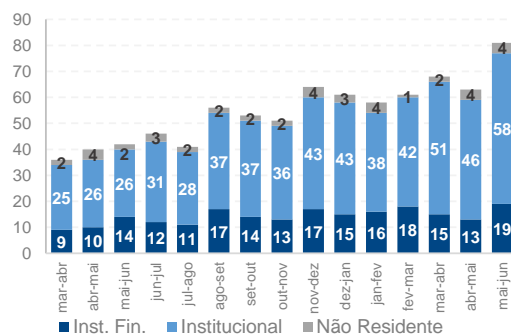


Participação por Tipo de Investidor - Desde Fev/17

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

