

Informações Contratos Disponíveis

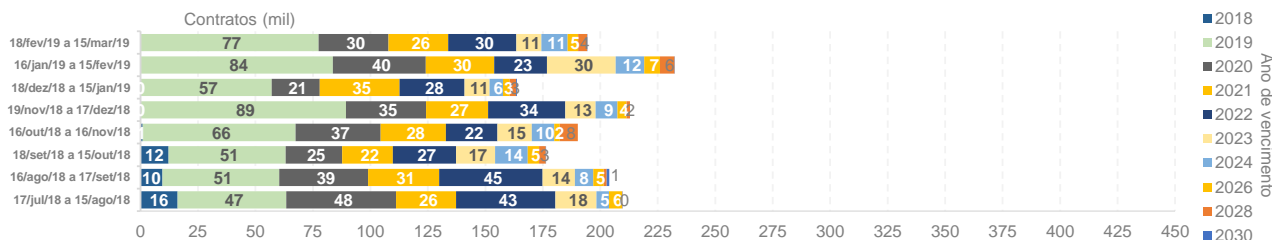
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPJ19	WLJ9 Index	15/04/2019	21	0,90%	99.925,36	1,06	0,68%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPK19	WLK9 Index	15/05/2019	41	0,71%	99.884,96	2,07	0,73%	
Tick Size	0,01%	DAPM19	WLM9 Index	17/06/2019	64	1,75%	99.560,37	3,19	0,83%	
Lote padrão	5	DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	212	2,73%	97.759,60	10,28	1,63%	
Informações de Mercado		DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	359	2,58%	96.436,19	17,20	2,28%	
Data	15/03/2019	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	463	2,81%	95.035,84	21,82	2,58%	
DI	6,40%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	545	2,91%	93.984,89	25,37	2,86%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	860	3,48%	88.981,46	37,69	4,37%	
Data início	18/02/2019	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	1.046	3,72%	85.932,61	44,17	5,08%	
Data fim	15/03/2019	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.362	4,02%	80.814,17	53,93	6,25%	
DU Mês Total	17	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.867	4,15%	73.989,01	67,59	8,16%	
Índice Inflação Inicial	5.116,93	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.368	4,32%	67.205,23	77,73	9,94%	
1ª Prêvia IPCA	08/02/2019	0,34%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.868	4,38%	61.392,81	85,95	11,82%
2ª Prêvia IPCA	21/02/2019	0,34%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	4.061	4,47%	49.425,26	97,87	16,40%
IPCA IBGE	10/03/2019	0,43%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.138,93									

*Por contrato

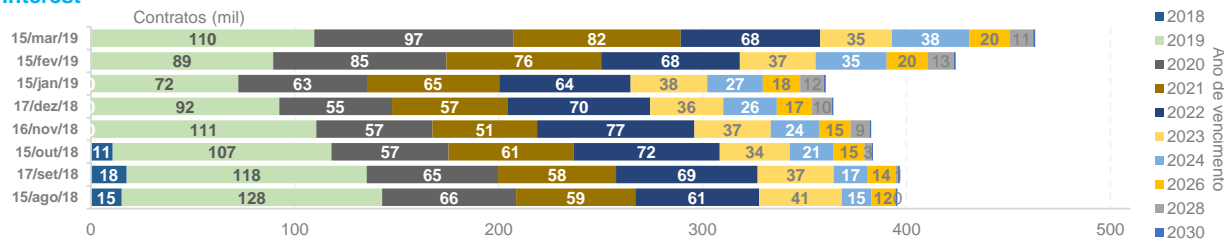
**Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



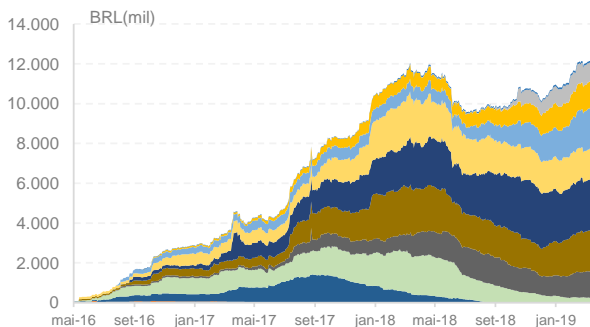
Open Interest



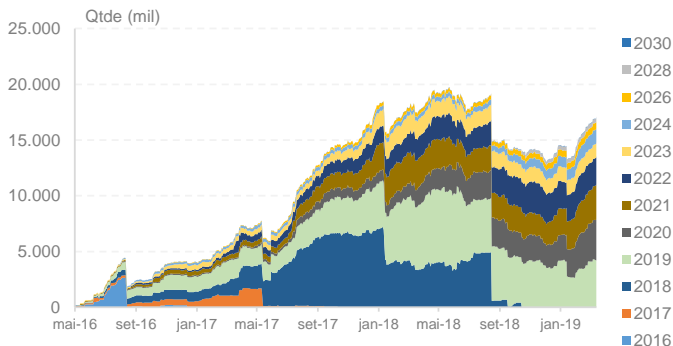
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



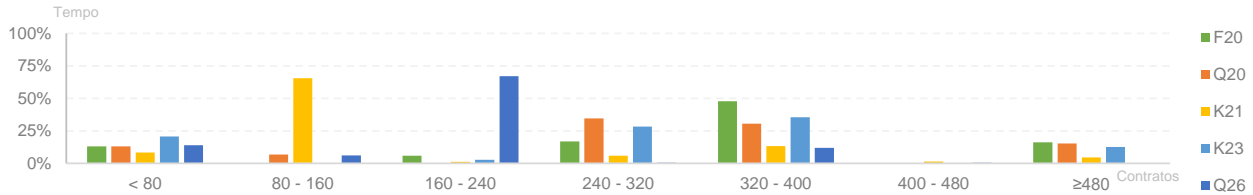
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

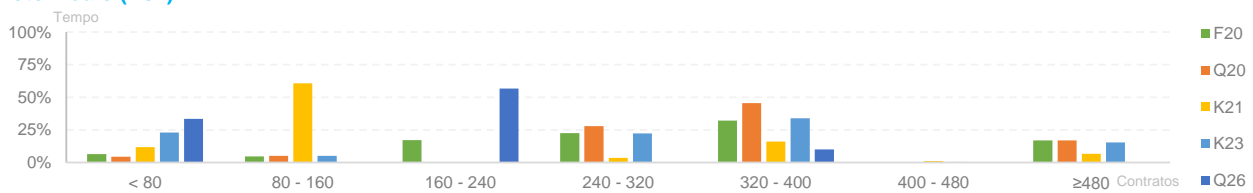
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/20 (F20), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), MAI/23 (K23) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 300 contratos (F20, Q20, K21 e K23) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 10 bps (Q20, K21 e K23), 16 bps (F20) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam 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 Março/19

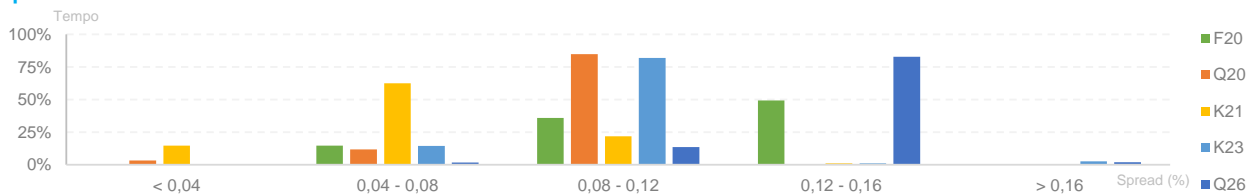
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

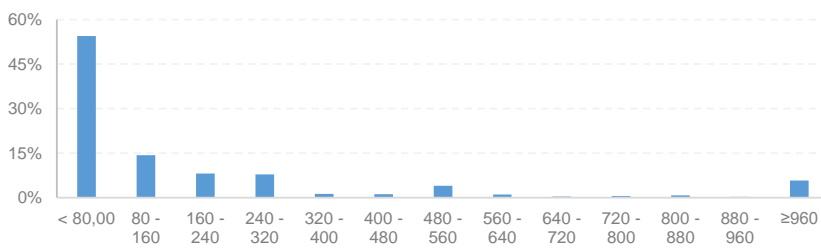


Spread Médio

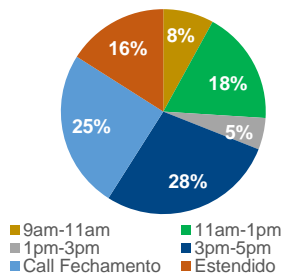


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

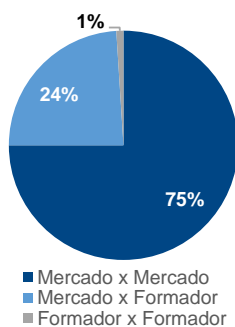


Por Janelas de Negociação

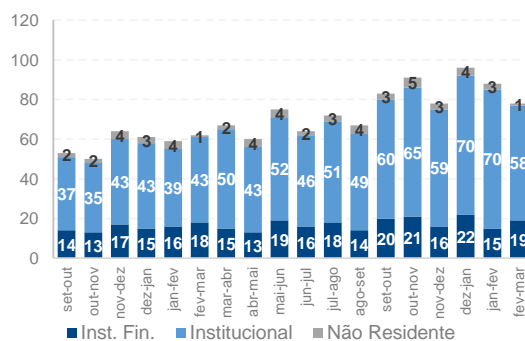


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

