

CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

1. Informações dos Contratos Disponíveis

ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO

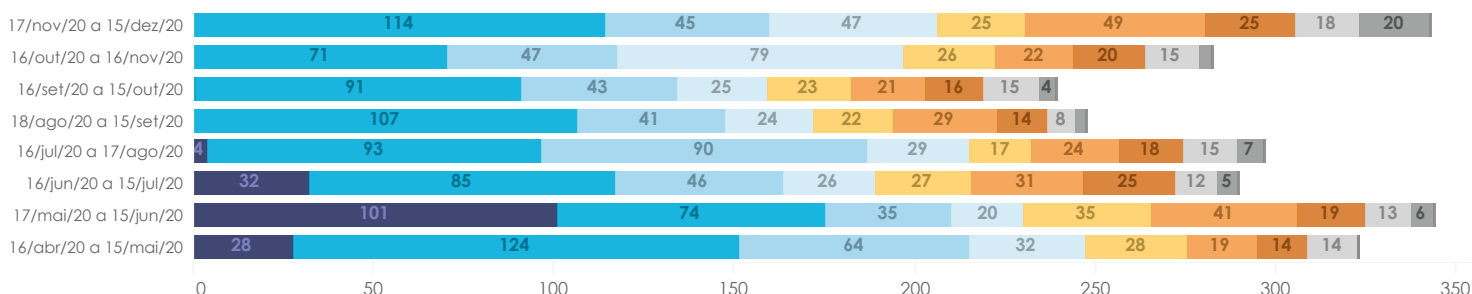
PU DO CONTRATO (PONTOS)	100.000
VALOR DO PONTO (BRL)	0,00025
TICK SIZE	0,01%
LOTE PADRÃO	1
INFORMAÇÕES DE MERCADO	
DATA	16/12/2020
DI	1,90%
DADOS DE INFLAÇÃO	
DATA INÍCIO	17/11/2020
DATA FIM	15/12/2020
DU MÊS TOTAL	21
ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL	5.438,12
1ª PRÉVIA IPCA	06/11/2020 0,47%
2ª PRÉVIA IPCA	24/11/2020 0,77%
IPCA IBGE	08/12/2020 0,89%
ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO	5.486,52

Código B3	Código Bbg	Vencimento	DU	Taxa	PU	BPV*	Margem**
DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	20	-12,35%	101.052	1,22	0,66%
DAPG21	WLG21 Index	17/02/2021	41	-4,82%	100.807	2,30	0,72%
DAPH21	WLH21 Index	15/03/2021	59	-4,42%	101.064	3,31	0,83%
DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	102	-3,20%	101.325	5,66	1,03%
DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	272	-1,19%	101.301	14,78	2,03%
DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	417	0,00%	100.000	22,10	2,56%
DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	603	0,67%	98.415	31,25	3,22%
DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	919	1,53%	94.613	45,39	4,63%
DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1106	1,83%	92.349	53,16	5,34%
DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1424	2,33%	87.796	64,75	6,52%
DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	1925	2,81%	80.921	80,29	8,38%
DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2425	3,10%	74.544	92,91	10,06%
DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3618	3,60%	60.184	111,34	14,58%

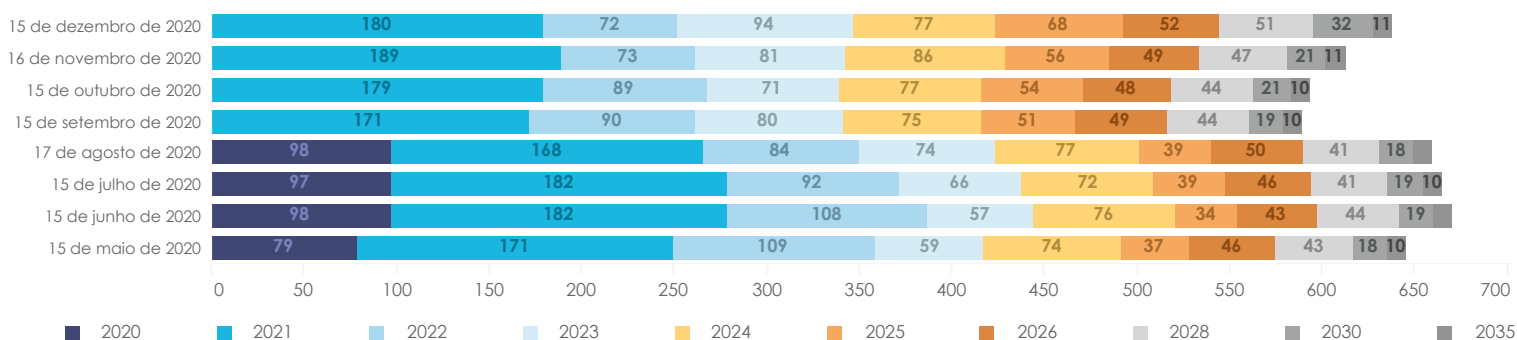
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

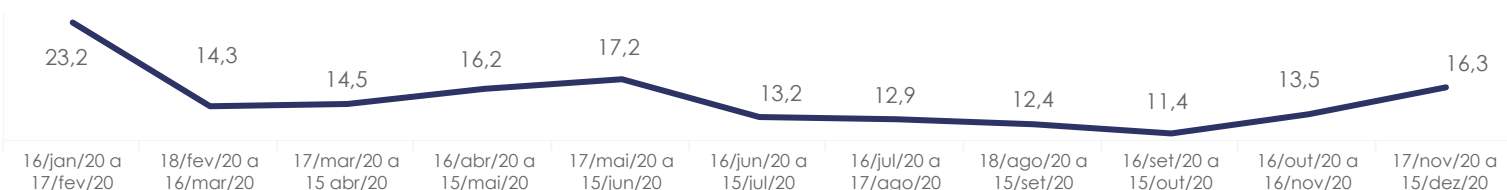
Contratos Negociados (em Milhares)



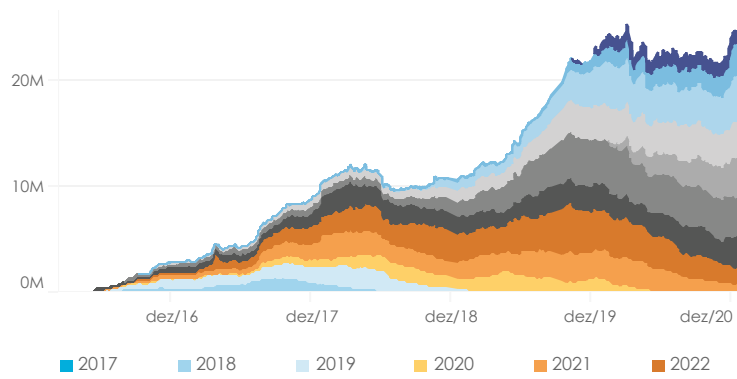
Open Interest (em Milhares)



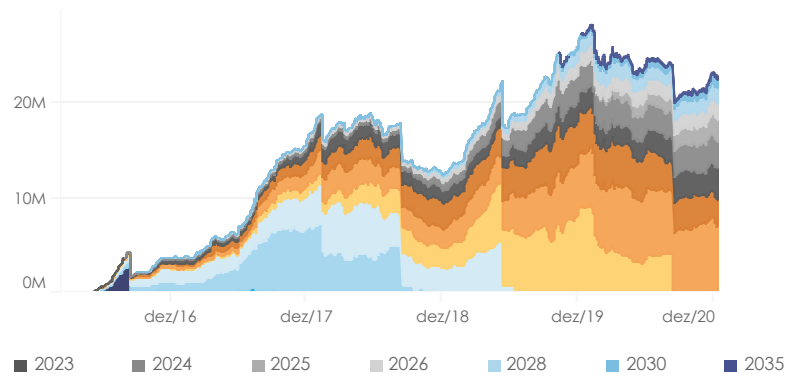
ADV (em Milhares de Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



3. Programa de Formador de Mercado

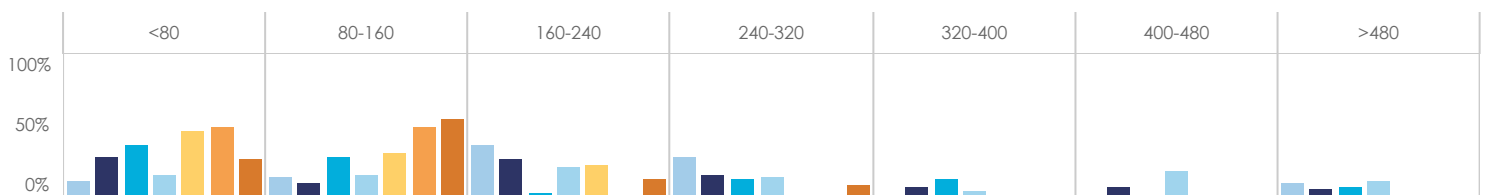
Obrigações do Formador de Mercado

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	Formadores atuam na sessão de negociação (80% do período das 10h30 a 12h e 15h a 16h30), no call de fechamento (durante 1 minuto e 10 segundos por vencimento obrigatório) e no período estendido (das 17h20 a 17h40)
		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			8 bps	60	4 bps		
			mai/25			60	50	5 bps		
			ago/26	15 bps		15 bps	40	5		
			ago/28			13 bps	5 bps			
		ago/30	100	5 bps						

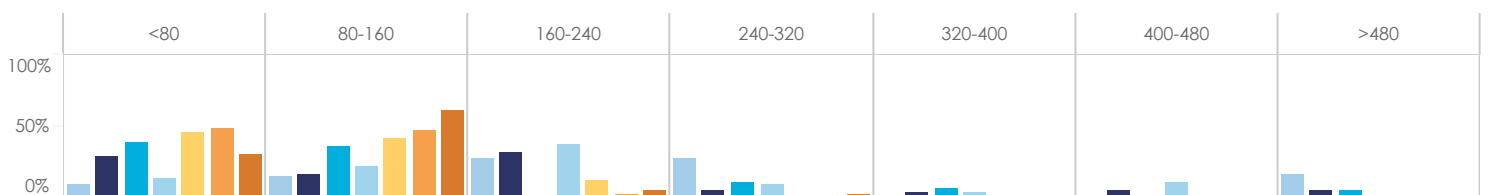
4. Vencimentos Mais Líquidos

Informações do Topo do Livro (17/11 a 15/12)

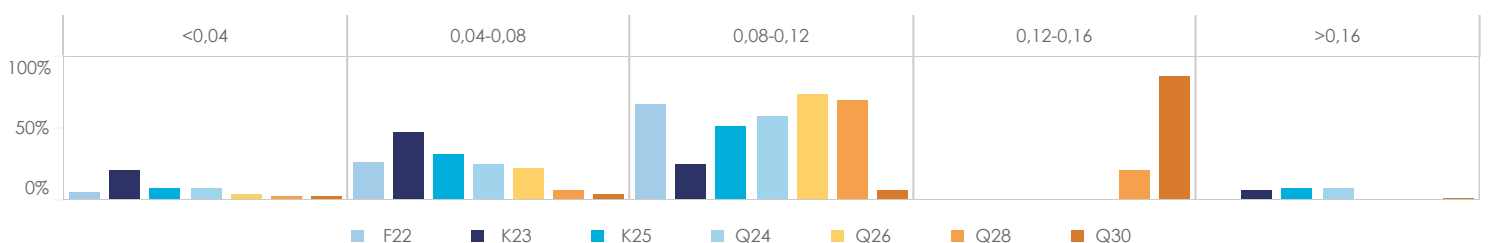
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

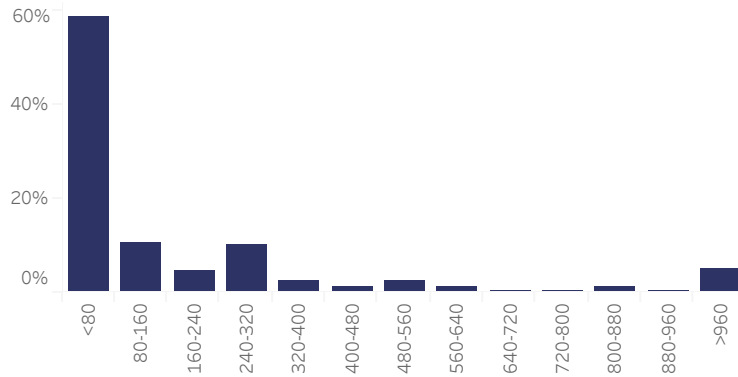


Spread Médio

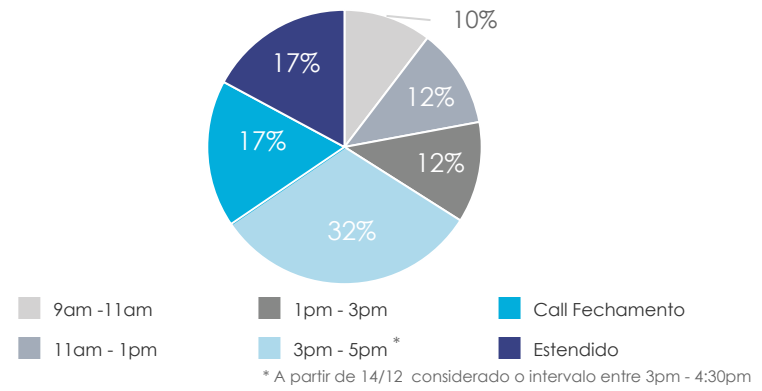


5. Frequência de Execução das Ordens

Por Lote Executado

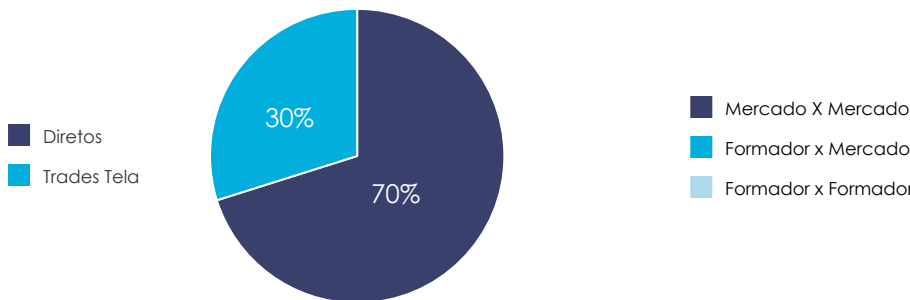


Por Janela de Negociação



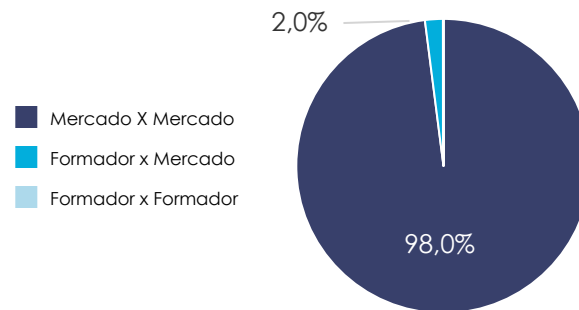
6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

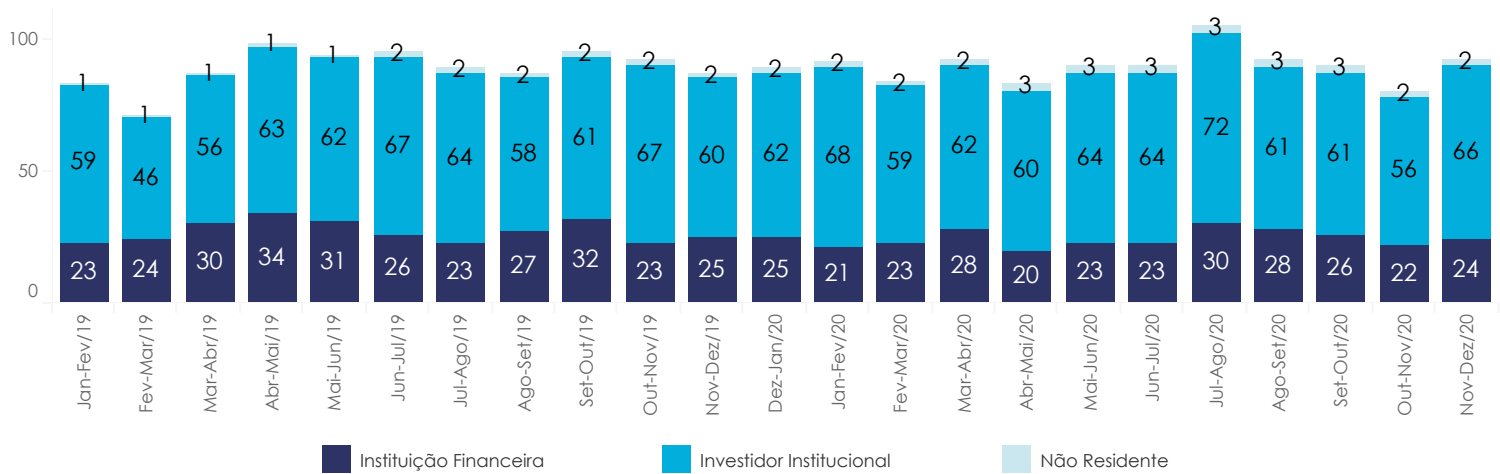


7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM

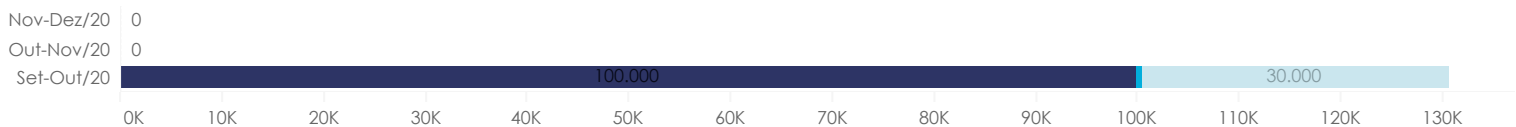


8. Número de Instituições Negociando DAP

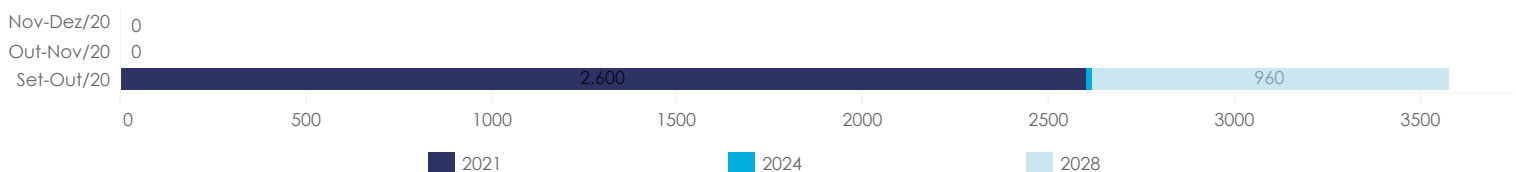


9. Casado de DAP com NTN-B

Quantidade



Quantidade em DAP Equivalente



Contate-nos

B3 clientes CLIENTES.B3.COM.BR
Institucional B3.COM.BR