

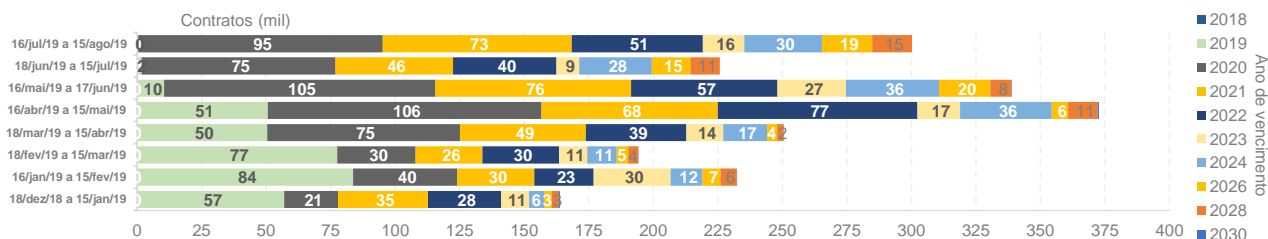
Informações Contratos Disponíveis

Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPU19	WLU9 Index	16/09/2019	22	3,98%	99.659,86	1,09	0,71%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPV19	WLV9 Index	15/10/2019	43	3,72%	99.378,70	2,14	0,75%	
Tick Size	0,01%	DAPX19	WLX9 Index	18/11/2019	66	3,38%	99.133,17	3,28	0,83%	
Lote padrão	5	DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	106	3,11%	98.720,02	5,26	0,99%	
Informações de Mercado		DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	253	2,10%	97.935,12	12,58	1,87%	
Data	15/08/2019	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	357	2,11%	97.085,25	17,59	2,28%	
DI	5,90%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	439	2,07%	96.493,69	21,51	2,53%	
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	754	2,47%	92.959,52	35,44	3,98%	
Data início	16/07/2019	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	940	2,71%	90.507,11	42,92	4,74%	
Data fim	15/08/2019	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.256	2,90%	86.720,18	54,84	5,92%	
DU Mês Total	22	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.761	3,21%	80.188,28	70,88	7,88%	
Índice Inflação Inicial	5.214,27	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.262	3,48%	73.560,72	83,30	9,70%	
1ª Prévía IPCA	10/07/2019	0,23%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.762	3,51%	68.515,55	94,70	11,50%
2ª Prévía IPCA	23/07/2019	0,22%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.955	3,82%	55.523,70	109,53	16,40%
IPCA IBGE	08/08/2019	0,19%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.224,18									

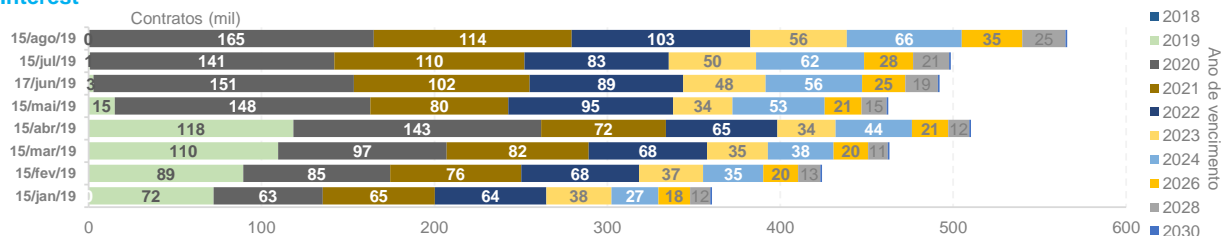
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



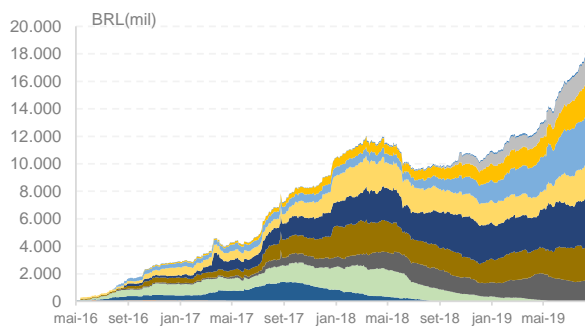
Open Interest



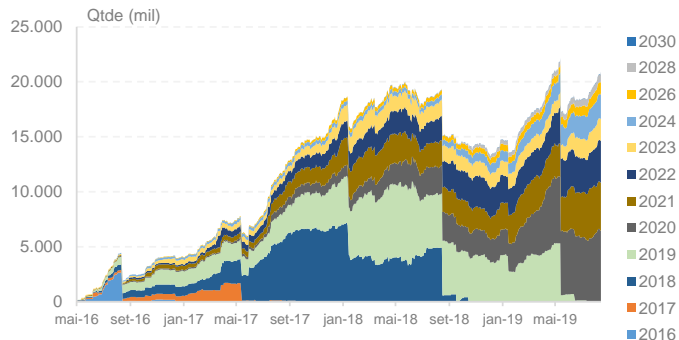
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



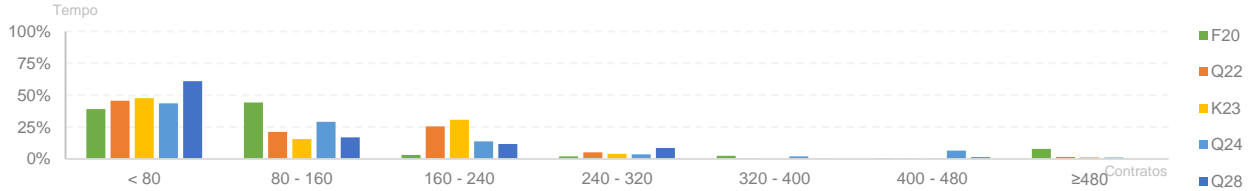
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

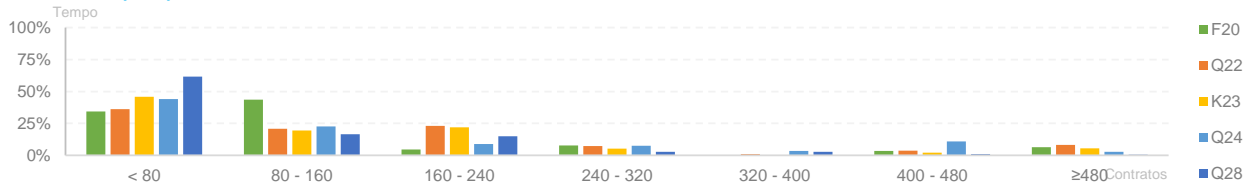
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/20 (F20), AGO/22 (Q22), MAI/23 (K23), AGO/24 (Q24) e AGO/28 (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo A*: 300 contratos (F20, Q22, K23 e Q24) e 160 contratos (Q28) na compra e na venda
- Spread Máximo *Modelo A*: 14 bps (F20), 10 bps (Q22, K23 e Q24) e 15 bps (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo B*: 150 contratos (F20), 100 contratos (Q22 e K23), 80 contratos (Q24) e 60 contratos (Q28)
- Spread Máximo *Modelo B*: 18 bps (F20), 6 bps (Q22 e K23), 8 bps (Q24) e 13 bps (Q28)
- Presença em tela: Itaú, Santander, TMG e Mercury 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 Agosto/19

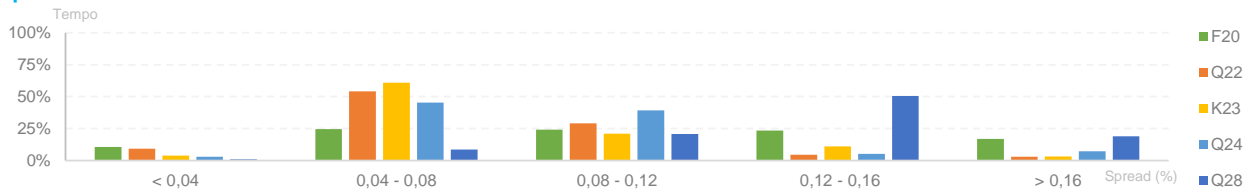
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

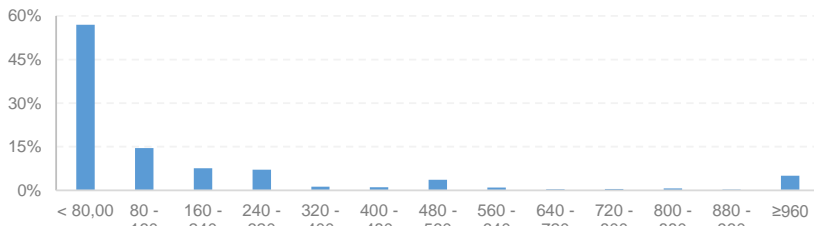


Spread Médio

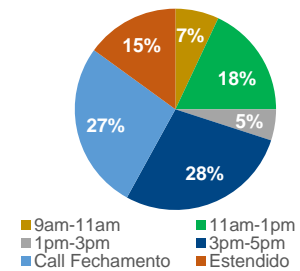


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

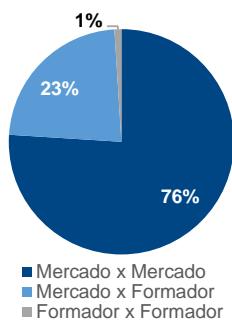


Por Janelas de Negociação

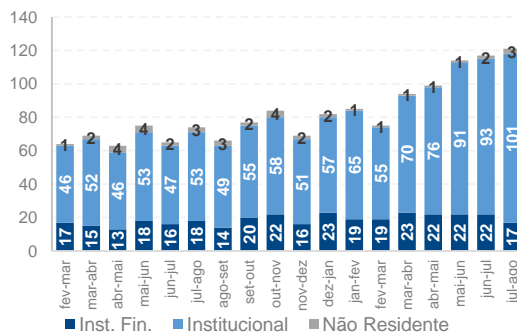


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

