

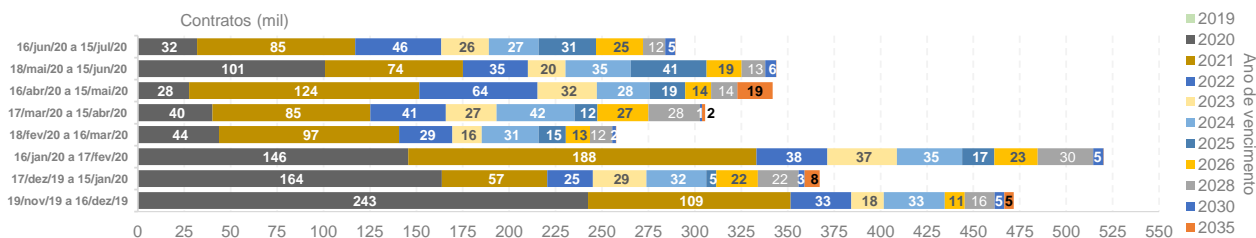
Informações Contratos Disponíveis

Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	23	-2,91%	100.269,90	1,25	0,68%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPU20	WLU20 Index	15/09/2020	43	-0,87%	100.149,21	2,29	0,73%	
Tick Size	0,01%	DAPV20	WLV20 Index	15/10/2020	64	-0,72%	100.183,69	3,41	0,85%	
Lote padrão	5	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	127	-1,02%	100.518,02	6,81	1,12%	
Informações de Mercado										
Data	15/07/2020	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	379	-0,45%	100.680,62	20,25	2,39%	
DI	2,15%	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	524	0,29%	99.399,67	27,43	2,79%	
Dados de Inflação										
Data início	15/06/2020	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	710	0,73%	97.971,58	36,48	3,83%	
Data fim	15/07/2020	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.026	1,42%	94.420,91	50,45	5,07%	
DU Mês Total	22	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1.213	1,81%	91.727,76	57,72	5,73%	
Índice Inflação Inicial	5.311,65	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.531	2,30%	87.096,68	68,84	6,96%	
1ª Prévía IPCA	10/06/2020	0,22%	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.032	2,85%	79.724,31	83,18	8,74%
2ª Prévía IPCA	25/06/2020	0,27%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.532	3,21%	72.799,57	94,31	10,37%
IPCA IBGE	10/07/2020	0,26%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.725	3,88%	56.967,75	107,84	15,21%
Índice Pro-Rata Calculado	5.325,46									

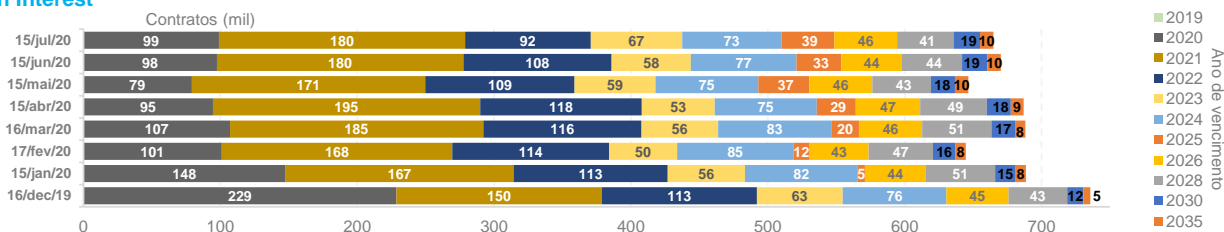
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



Open Interest

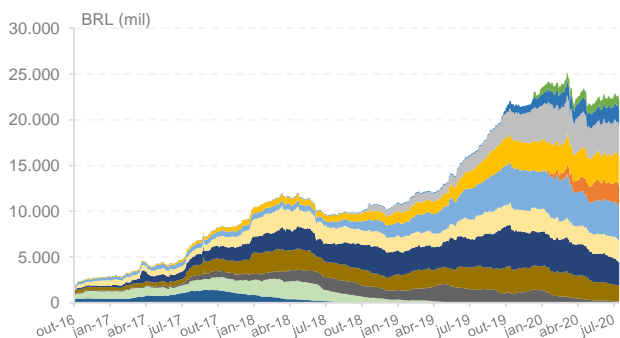


ADV (Contratos)

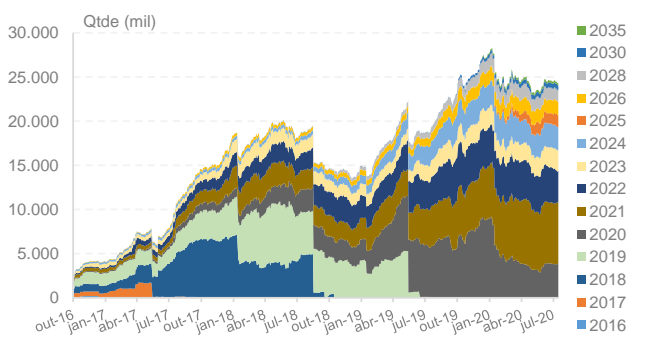


16/ago/19 a 16/set/19 | 17/set/19 a 15/out/19 | 16/out/19 a 18/nov/19 | 19/nov/19 a 16/dez/19 | 17/dez/19 a 15/jan/20 | 16/jan/20 a 17/fev/20 | 18/fev/20 a 16/mar/20 | 17/mar/20 a 15/abr/20 | 16/abr/20 a 15/mai/20 | 18/mai/20 a 15/jun/20 | 16/jun/20 a 15/jul/20

Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



Atualização: 15/julho/20

Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

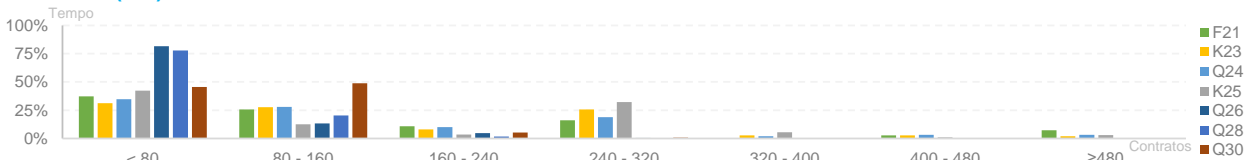
Formador de Mercado		Período de atuação	Vencimentos	Modelo A		Modelo B		Horários	
Modelo A	Modelo B			Camada 1		Camada 1*		Camada 2*	
				Spread Máximo	Quantidade Mínima	Spread Máximo	Quantidade Mínima	Spread Máximo	Quantidade Mínima
Itaú Santander	Mercury TMG	02/05/2020 a 14/07/2020	jan/21	14 bps	300	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		8 bps	60	3 bps	
			ago/26	10 bps		8 bps	50	4 bps	
			ago/28	15 bps		10 bps	40	4 bps	
			ago/30	15 bps		100	13 bps	40	

*Atuação simultânea em ambas as camadas

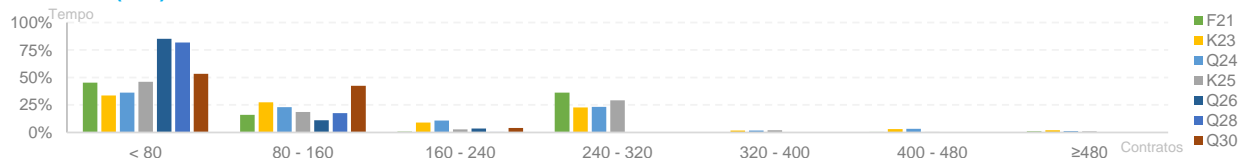
**8 bps a partir de 23/07

Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro (15/06 a 15/07)

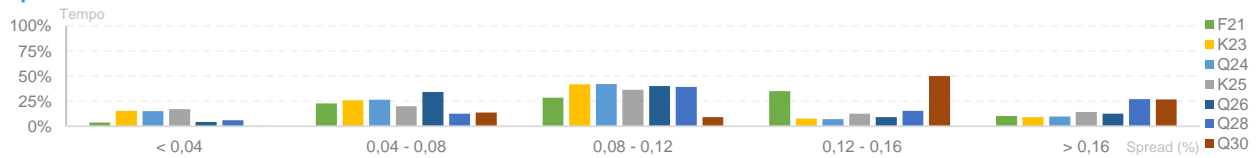
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

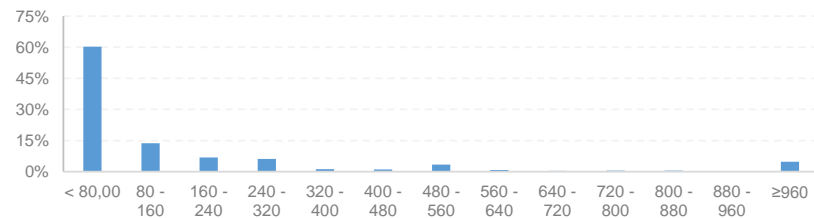


Spread Médio

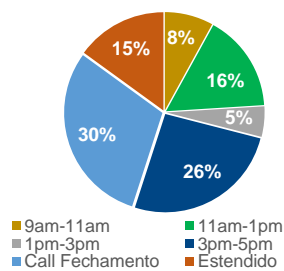


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

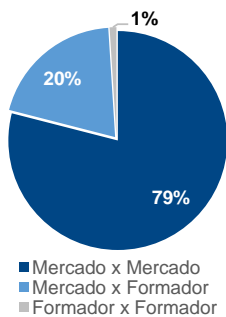


Por Janelas de Negociação

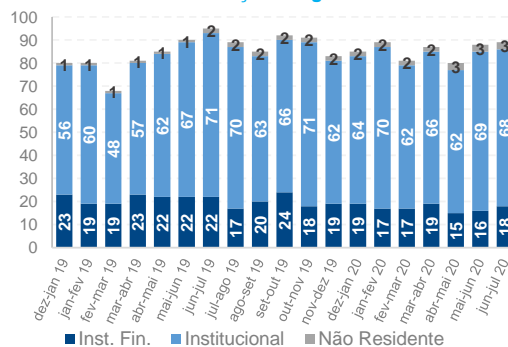


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

