

CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

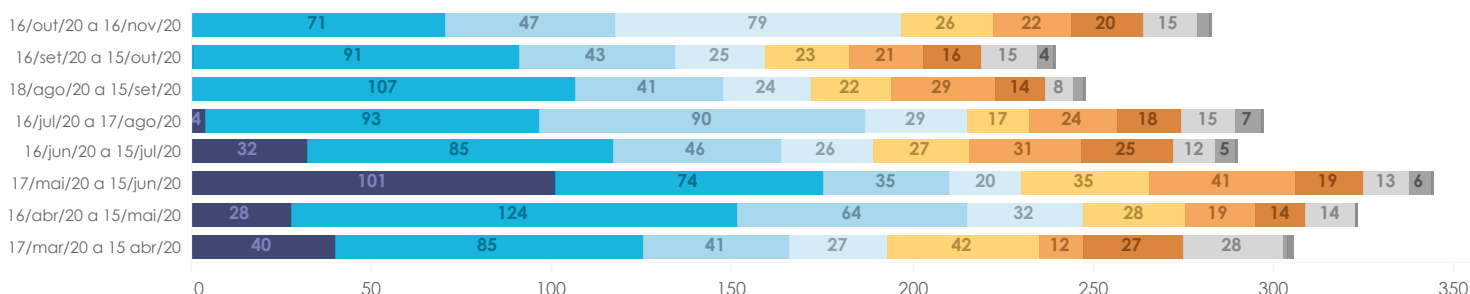
1. Informações dos Contratos Disponíveis

ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO		Código B3	Código Bbg	Vencimento	DU	Taxa	PU	BPV*	Margem**
PU DO CONTRATO (PONTOS)	100.000	DAPZ20	WLZ20 Index	15/12/2020	21	-3,96%	100.337	1,16	0,67%
VALOR DO PONTO (BRL)	0,00025	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	42	-6,01%	101.038	2,39	0,68%
TICK SIZE	0,01%	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	124	-3,25%	101.639	6,91	1,12%
LOTE PADRÃO	5	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	294	-0,95%	101.120	15,91	2,13%
INFORMAÇÕES DE MERCADO		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	439	0,10%	99.826	23,21	2,61%
DATA	17/11/2020	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	625	0,87%	97.875	32,15	3,33%
DI	1,90%	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	941	1,93%	93.111	45,56	4,72%
DADOS DE INFLAÇÃO		DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1128	2,30%	90.322	52,79	5,40%
DATA INÍCIO	16/10/2020	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1446	2,87%	85.013	63,33	6,58%
DATA FIM	16/11/2020	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	1947	3,38%	77.350	77,20	8,44%
DU MÊS TOTAL	21	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2447	3,70%	70.272	87,87	10,17%
ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL	5.391,75	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3640	4,21%	55.120	102,00	14,58%
1ª PRÉVIA IPCA	09/10/2020 0,64%								
2ª PRÉVIA IPCA	23/10/2020 0,81%								
IPCA IBGE	06/11/2020 0,86%								
ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO	5.438,12								

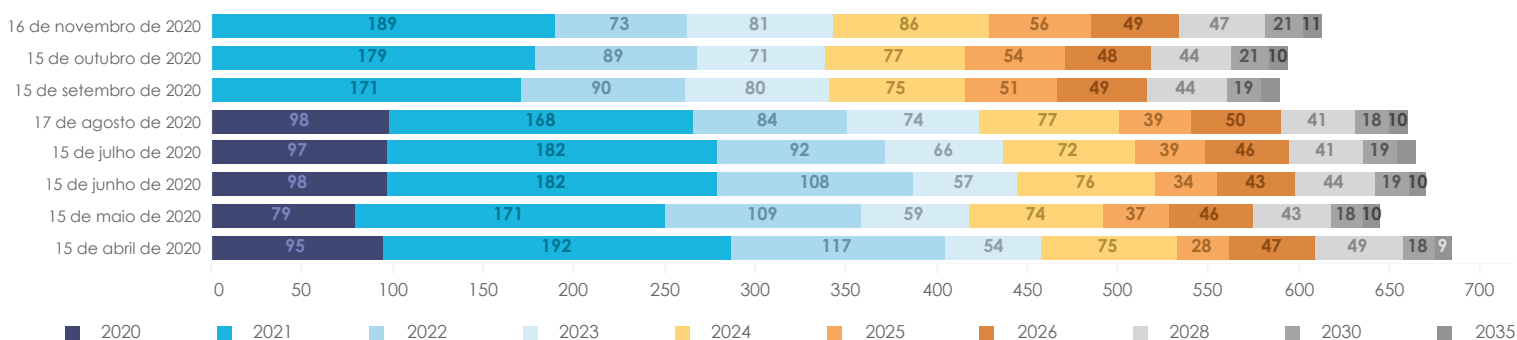
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

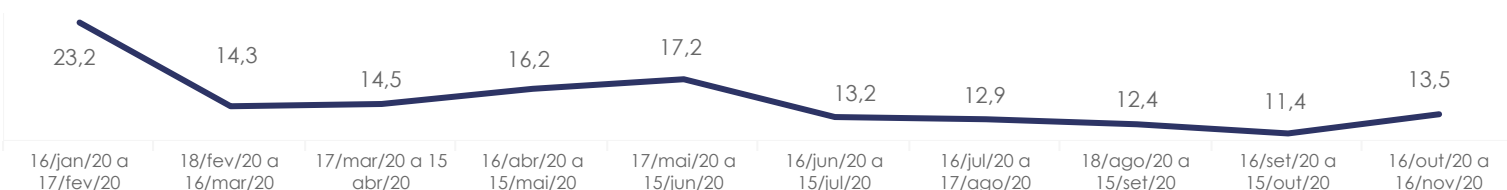
Contratos Negociados (em Milhares)



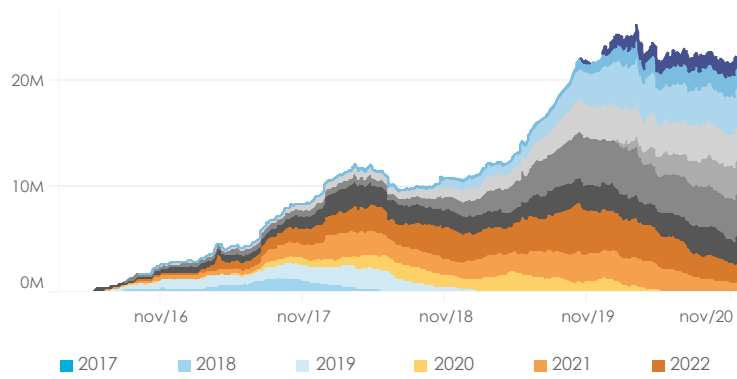
Open Interest (em Milhares)



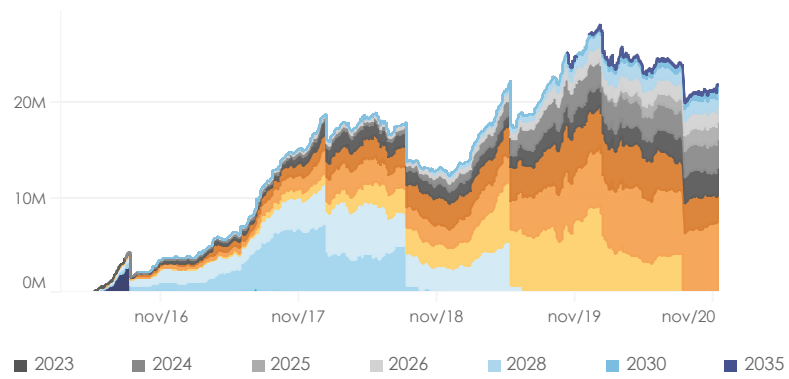
ADV (em Milhares de Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



3. Programa de Formador de Mercado

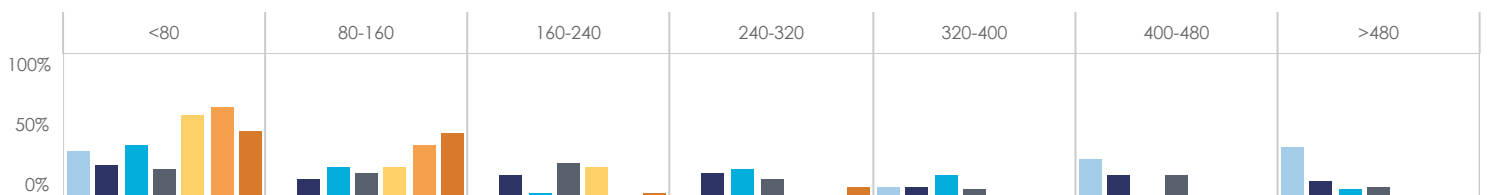
Obrigações do Formador de Mercado

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 16h50) e no call de fechamento (durante 1 minuto e 10 segundos por vencimento obrigatório)						
		15/07/2020 a 14/09/2020		20 bps							7 bps					
		15/09/2020 a 14/04/2021	jan/22	10 bps		8 bps		100			3 bps					
		15/04/2021 a 30/04/2021		14 bps								5 bps				
		02/05/2020 a 30/04/2021	mai/23	10 bps		60		6 bps			80	3 bps				
			ago/24													
			mai/25										60	8 bps	50	4 bps
			ago/26													
			ago/28										15 bps	100	13 bps	5 bps
		ago/30														

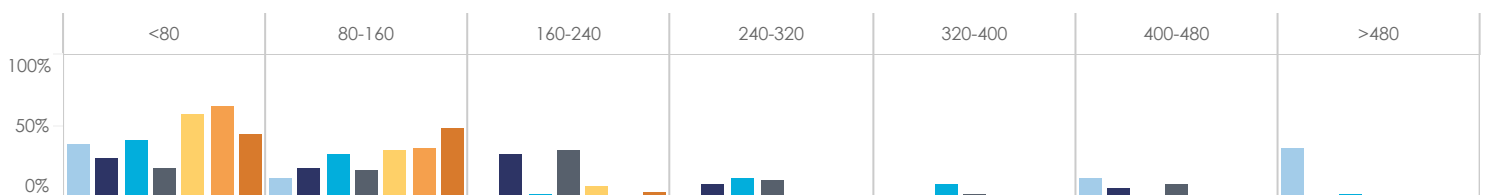
4. Vencimentos Mais Líquidos

Informações do Topo do Livro (16/10 a 16/11)

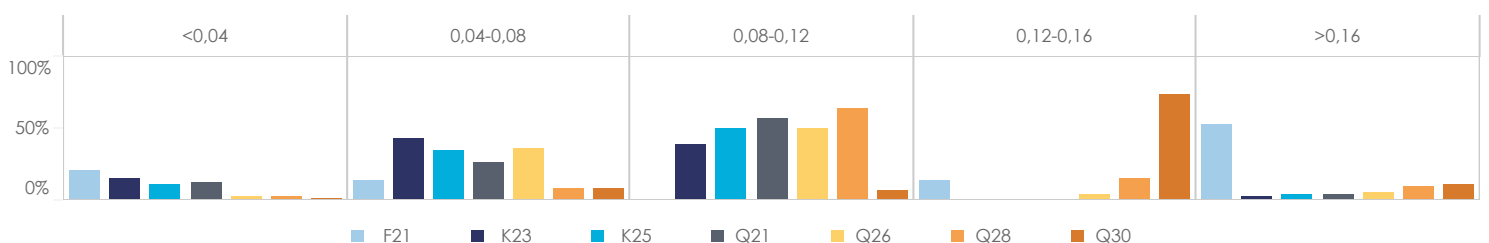
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

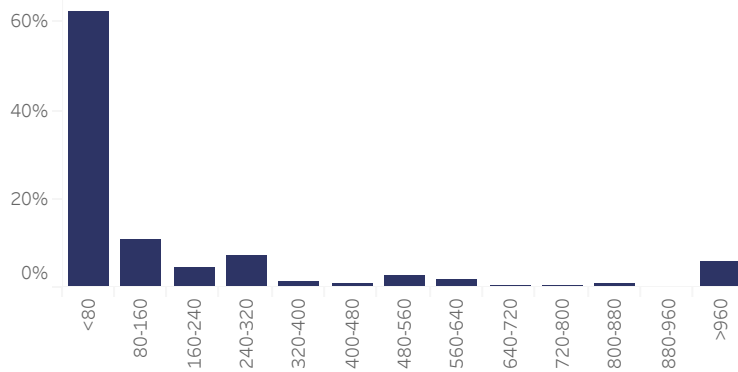


Spread Médio

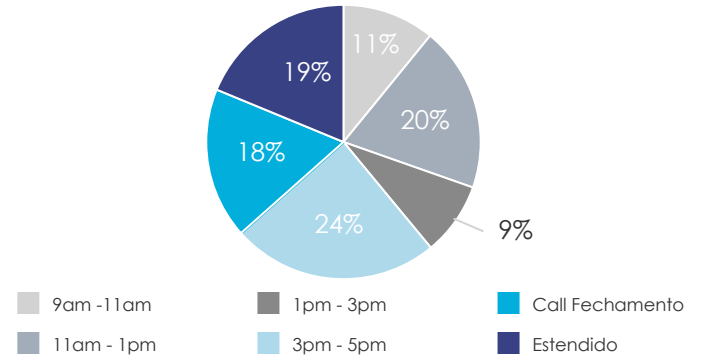


5. Frequência de Execução das Ordens

Por Lote Executado

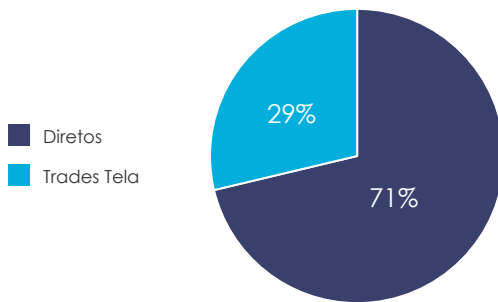


Por Janela de Negociação



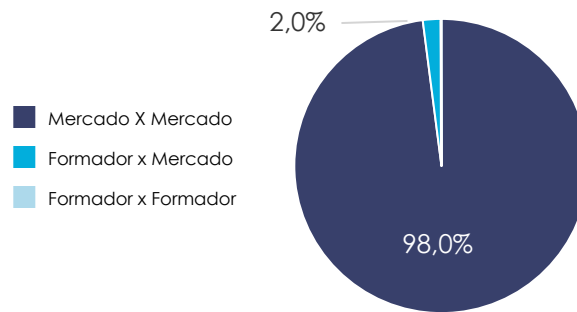
6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

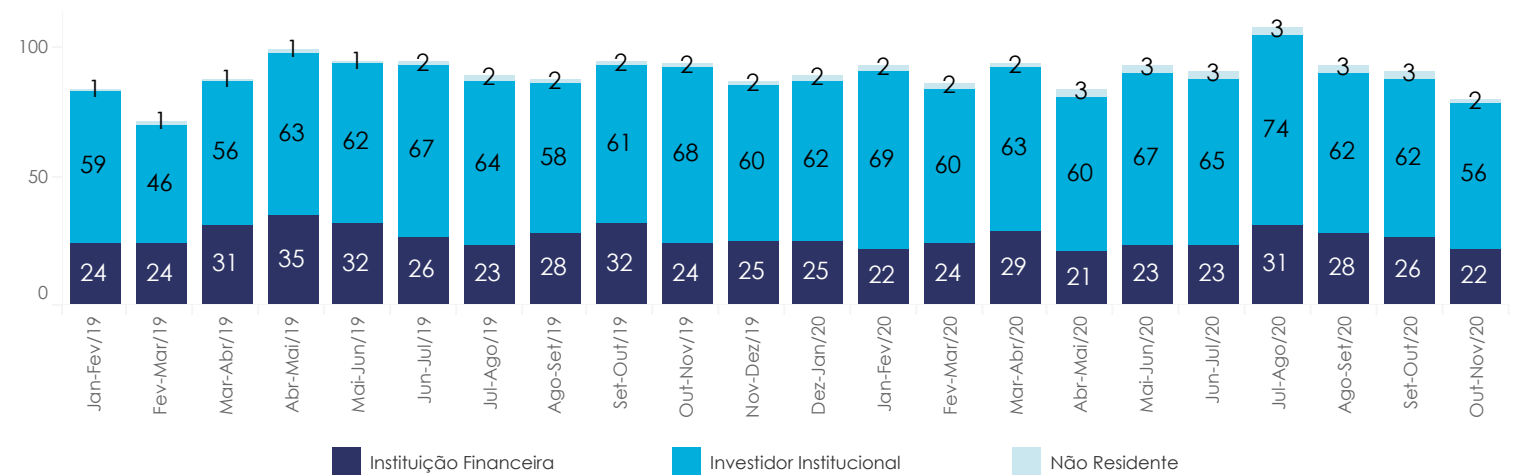


7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM

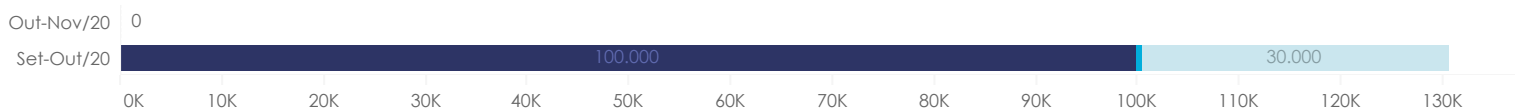


8. Número de Instituições Negociando DAP

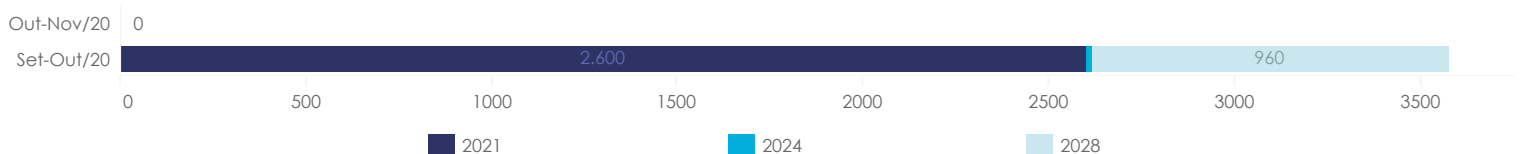


9. Casado de DAP com NTN-B

Quantidade



Quantidade em DAP Equivalente



Contate-nos

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

