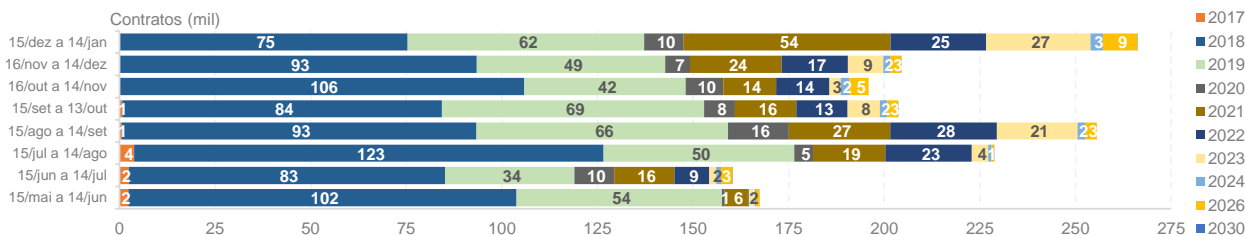


Informações Contratos Disponíveis

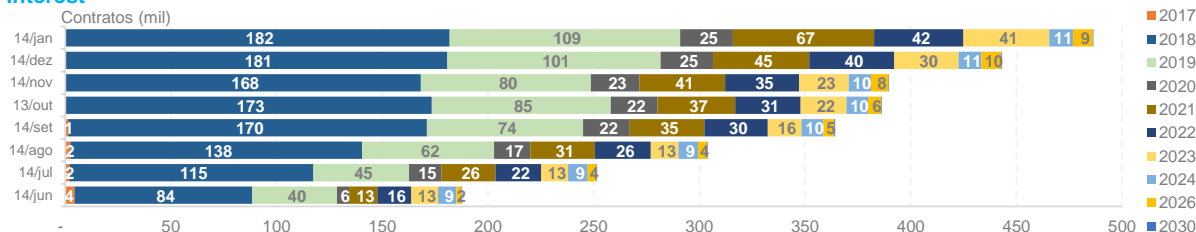
| Especificações do Contrato | | Cód. B3 | Cód. BBG | Vcto | DU | Taxa | PU | DV01* | Margem** | |
|----------------------------|------------|---------|---------------|-------------|------------------------------------|-------|-----------|-----------|----------|--------|
| PU do Contrato (pontos) | 100.000 | DAPG18 | WLG8 Index | 15/02/2018 | 21 | 1,27% | 99.894,89 | 1,01 | 0,60% | |
| Valor do Ponto (BRL) | 0,00025 | DAPH18 | WLH8 Index | 15/03/2018 | 41 | 2,39% | 99.616,46 | 1,95 | 0,62% | |
| Tick Size | 0,01% | DAPJ18 | WLJ8 Index | 16/04/2018 | 62 | 2,06% | 99.499,58 | 2,95 | 0,65% | |
| Lote padrão | 5 | DAPQ18 | WLQ8 Index | 15/08/2018 | 147 | 2,64% | 98.491,47 | 6,88 | 1,12% | |
| Informações de Mercado | | DAPF19 | WLF9 Index | 15/01/2019 | 250 | 2,85% | 97.250,66 | 11,53 | 1,89% | |
| Data | 15/01/2018 | DAPK19 | WLK9 Index | 15/05/2019 | 332 | 2,75% | 96.489,02 | 15,20 | 2,23% | |
| DI | 6,89% | DAPQ20 | WLQ20 Index | 17/08/2020 | 650 | 4,08% | 90.199,35 | 27,47 | 3,34% | |
| Dados de Inflação | | DAPK21 | WLK21 Index | 17/05/2021 | 836 | 4,42% | 86.633,50 | 33,82 | 4,06% | |
| Data início | 15/12/2017 | DAPQ22 | WLQ22 Index | 15/08/2022 | 1.151 | 4,80% | 80.723,62 | 43,23 | 5,09% | |
| Data fim | 15/01/2018 | DAPK23 | WLK23 Index | 15/05/2023 | 1.337 | 4,95% | 77.388,51 | 48,07 | 5,64% | |
| DU Mês Total | 19 | DAPQ24 | WLQ24 Index | 15/08/2024 | 1.653 | 5,05% | 72.385,58 | 55,53 | 6,79% | |
| Índice Inflação Inicial | 4.894,92 | DAPQ26 | WLQ26 Index | 17/08/2026 | 2.158 | 5,22% | 64.678,72 | 64,67 | 8,79% | |
| 1ª Prévia IPCA | 09/12/2017 | 0,27% | DAPQ30 | WLQ30 Index | 15/08/2030 | 3.159 | 5,30% | 52.341,29 | 76,54 | 12,46% |
| 2ª Prévia IPCA | 23/12/2017 | 0,26% | *Por contrato | | **Margem Teórica Máxima em % do PU | | | | | |
| IPCA IBGE | 08/01/2018 | 0,44% | | | | | | | | |
| Índice Pro-Rata Calculado | 4.916,46 | | | | | | | | | |

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

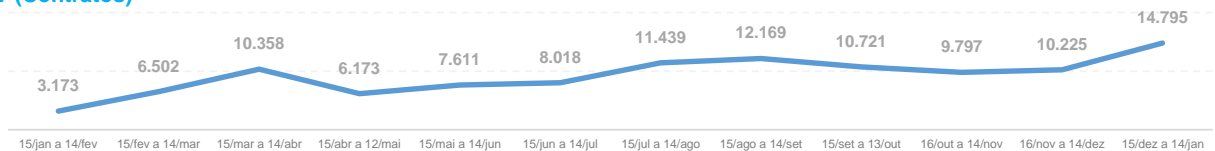
Contratos Negociados (desde 15/Mai/2017)



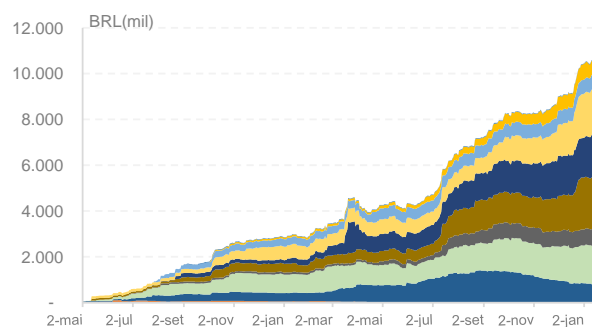
Open Interest



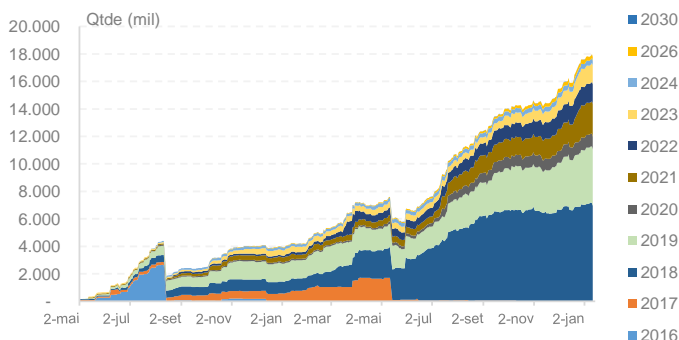
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



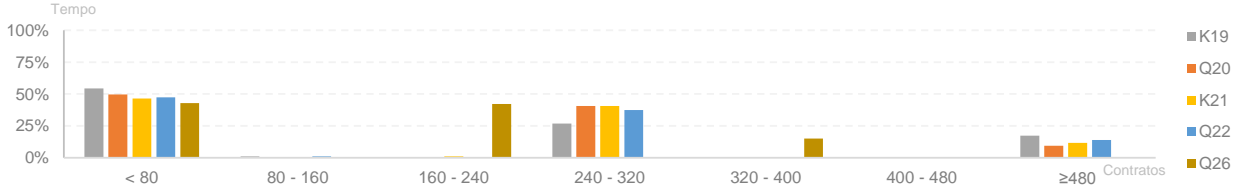
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

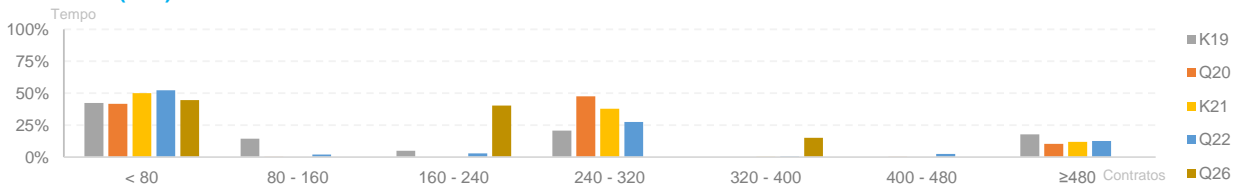
- Vencimentos Obrigatórios: MAI/19 (K19), AGO/20 (Q20), MAI/21 (K21), AGO/22 (Q22) e AGO/26 (Q26)
- Lote Mínimo: 260 contratos (K19, Q20, K21 e Q22) e 160 contratos (Q26) na compra e na venda
- Spread Máximo: 10 bps (K19, Q20, K21 e Q22) e 15 bps (Q26)
- Presença em tela: Itaú e Santander atuam em 80% do período de 10.30am a 12.00 e 2.20pm a 4.50pm

Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro em Dezembro/17

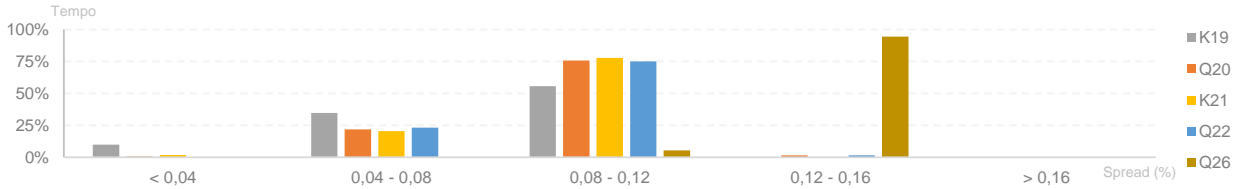
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

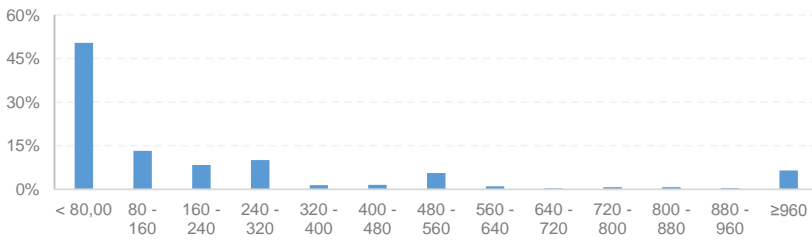


Spread Médio

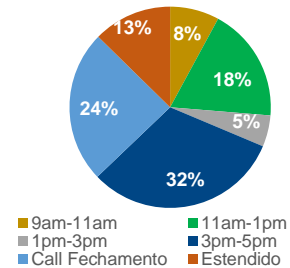


Frequência de Execução de Ordens - Desde Maio/16

Por Lote Executado

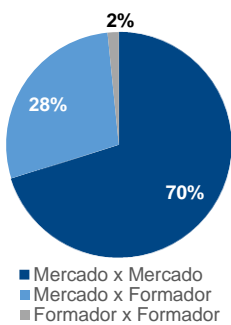


Por Janelas de Negociação

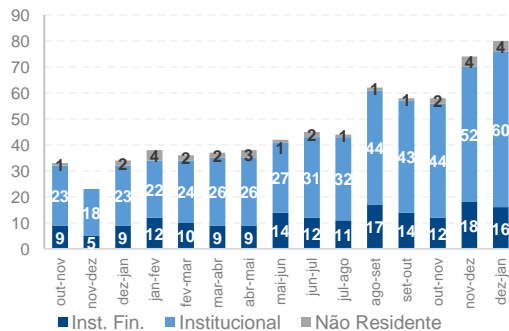


Participação por Tipo de Investidor - Desde Maio/16

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

