

CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

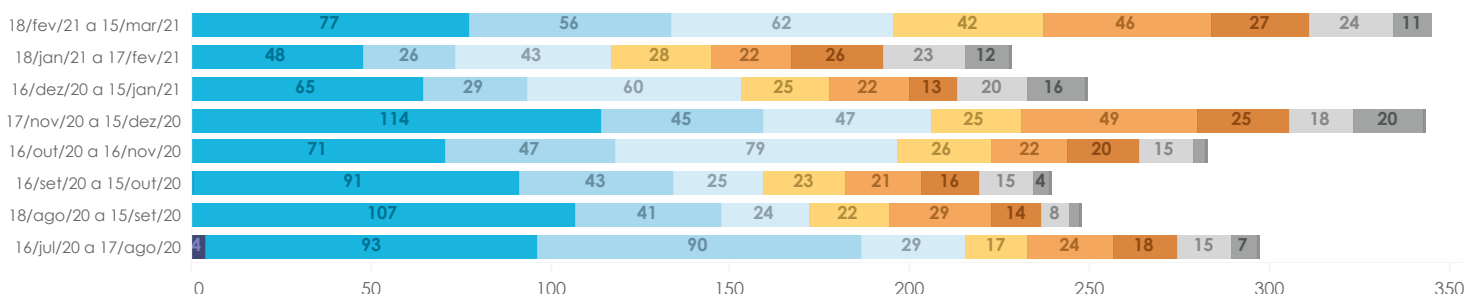
1. Informações dos Contratos Disponíveis

ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO		Código B3	Código Bbg	Vencimento	DU	Taxa	PU	BPV*	Margem**
PU DO CONTRATO (PONTOS)	100.000	DAPJ21	WLJ21 Index	15/04/2021	21	-4,98%	100.427	1,18	0,64%
VALOR DO PONTO (BRL)	0,00025	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	42	-6,15%	101.063	2,40	0,71%
TICK SIZE	0,01%	DAPM21	WLM21 Index	15/06/2021	62	-3,72%	100.937	3,45	0,85%
LOTE PADRÃO	1	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	212	-0,55%	100.465	11,35	1,70%
INFORMAÇÕES DE MERCADO		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	357	0,67%	99.058	18,62	2,34%
DATA	16/03/2021	DAPF23	WLF23 Index	16/01/2023	463	1,35%	97.566	23,63	2,63%
DI	1,90%	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	543	1,55%	96.740	27,42	2,85%
DADOS DE INFLAÇÃO		DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	859	2,46%	92.050	40,90	4,35%
DATA INÍCIO	18/02/2021	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1046	2,62%	89.821	48,53	5,07%
DATA FIM	18/03/2021	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1364	2,98%	85.305	59,88	6,21%
DU MÊS TOTAL	18	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	1865	3,29%	78.697	75,30	7,98%
ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL	5.574,49	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2365	3,57%	71.950	87,06	9,72%
1ª PRÉVIA IPCA	09/02/2021 0,66%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3558	3,90%	58.265	105,70	14,37%
2ª PRÉVIA IPCA	24/02/2021 0,66%	DAPQ40	WLQ40 Index	15/08/2040	4880	4,28%	44.416	110,09	19,85%
IPCA IBGE	11/03/2021 0,86%	DAPK45	WLK45 Index	15/05/2045	6071	4,60%	33.842	104,01	24,82%
ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO	5.622,43	DAPQ50	WLQ50 Index	15/08/2050	7390	4,66%	26.298	98,30	30,65%
		DAPK55	WLK55 Index	17/05/2055	8583	4,69%	20.991	91,09	36,49%

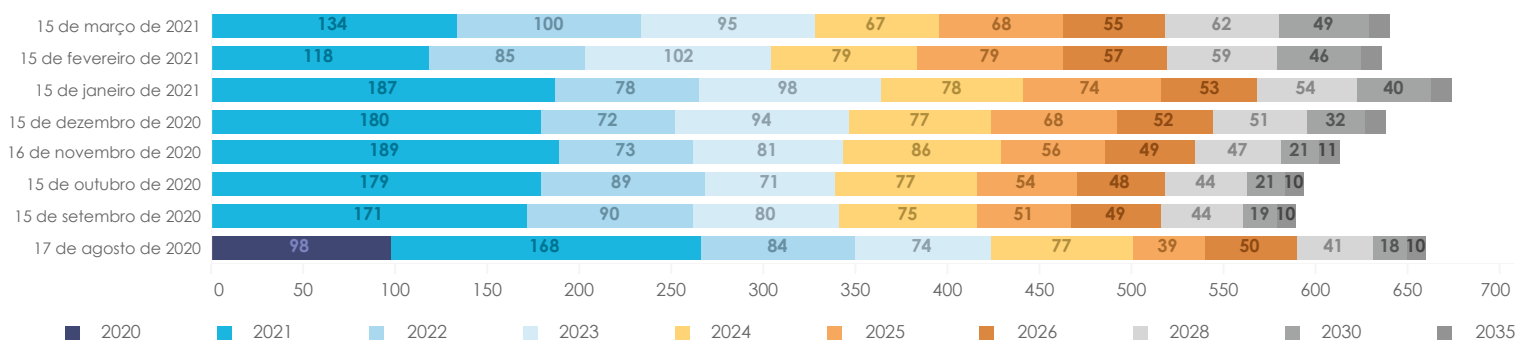
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

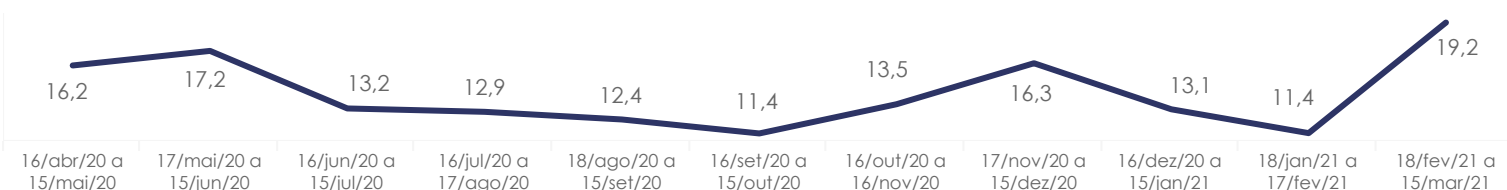
Contratos Negociados (em Milhares)



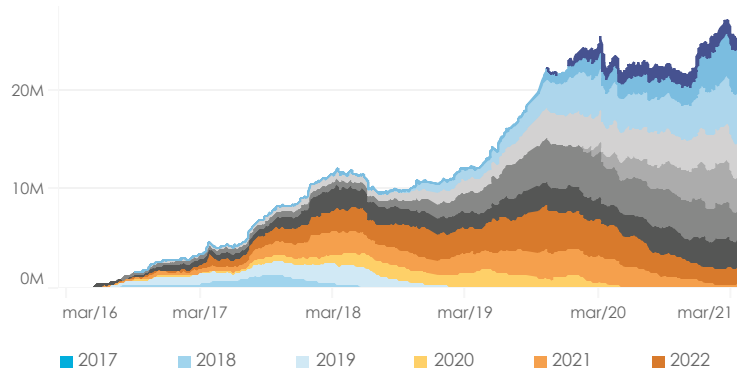
Open Interest (em Milhares)



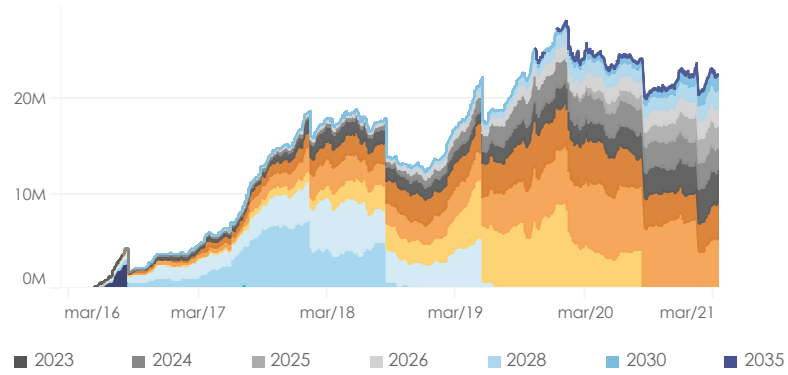
ADV (em Milhares de Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



3. Programa de Formador de Mercado

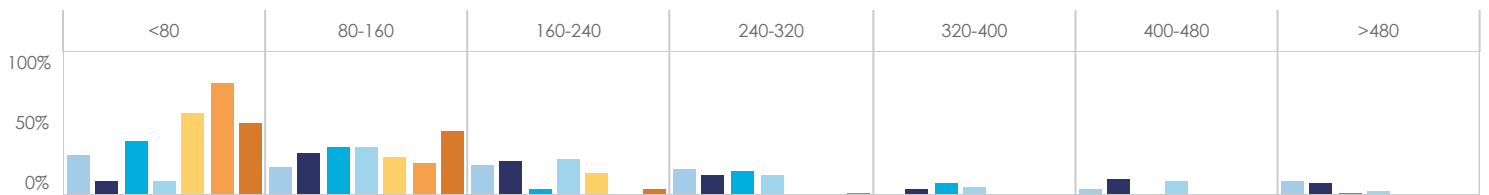
Obrigações do Formador de Mercado

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				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			60	8 bps	60			50
			mai/25								
			ago/26								
			ago/28			60	15 bps	4 bps			
		ago/30	15 bps	100		13 bps	40	5 bps			5

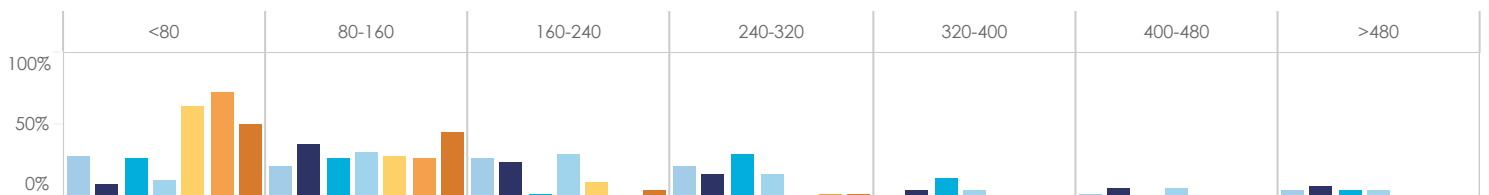
4. Vencimentos Mais Líquidos

Informações do Topo do Livro (18/02 a 15/03)

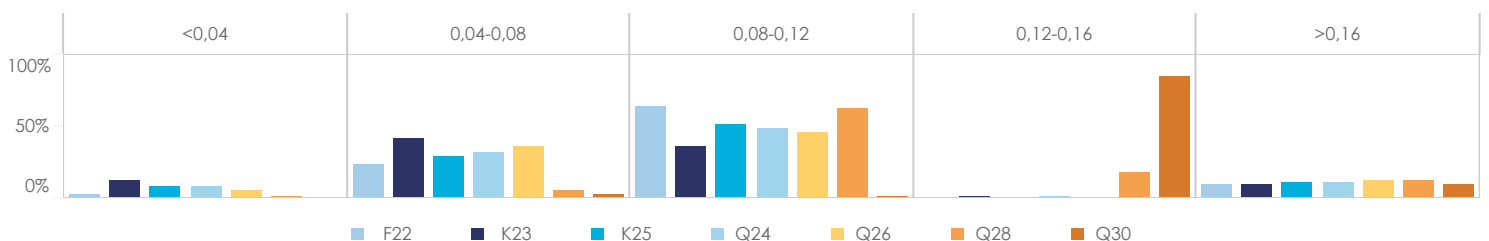
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

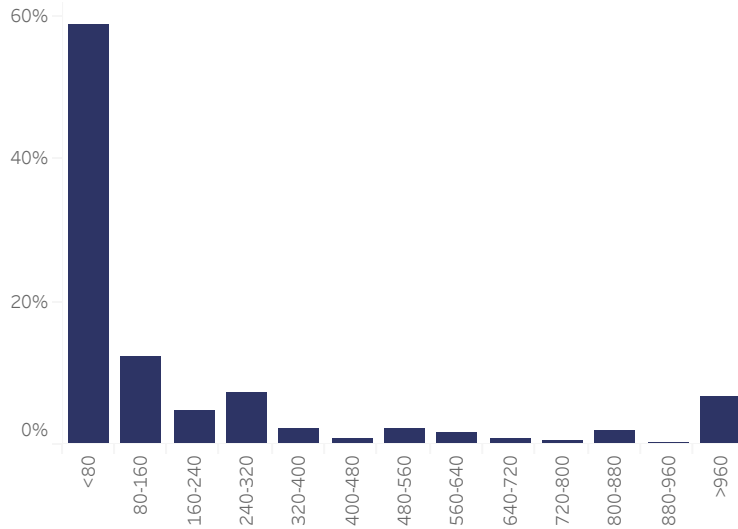


Spread Médio

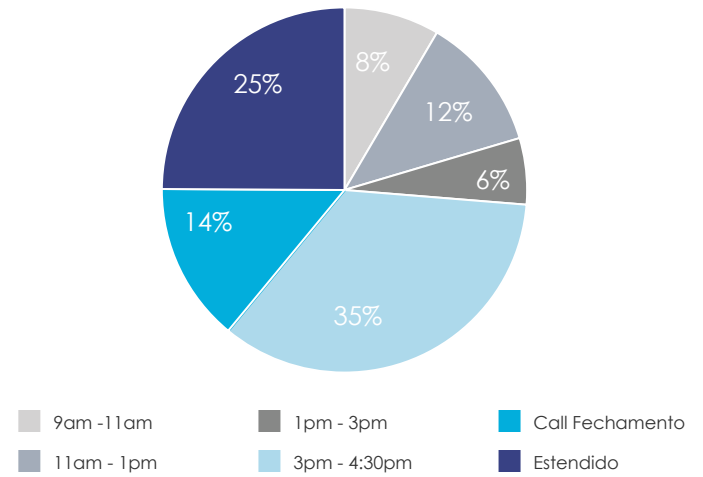


5. Frequência de Execução das Ordens

Por Lote Executado

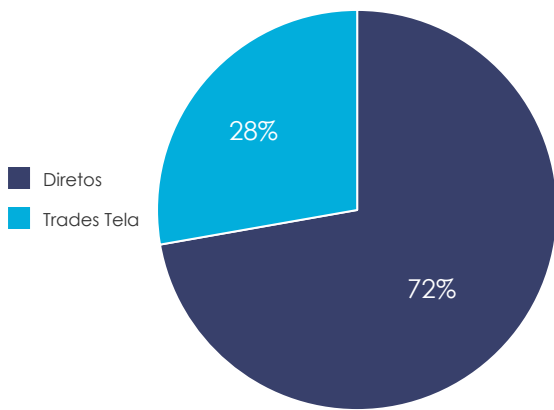


Por Janela de Negociação



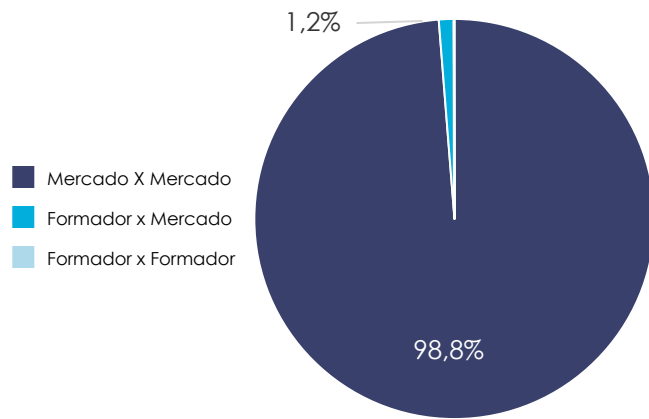
6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

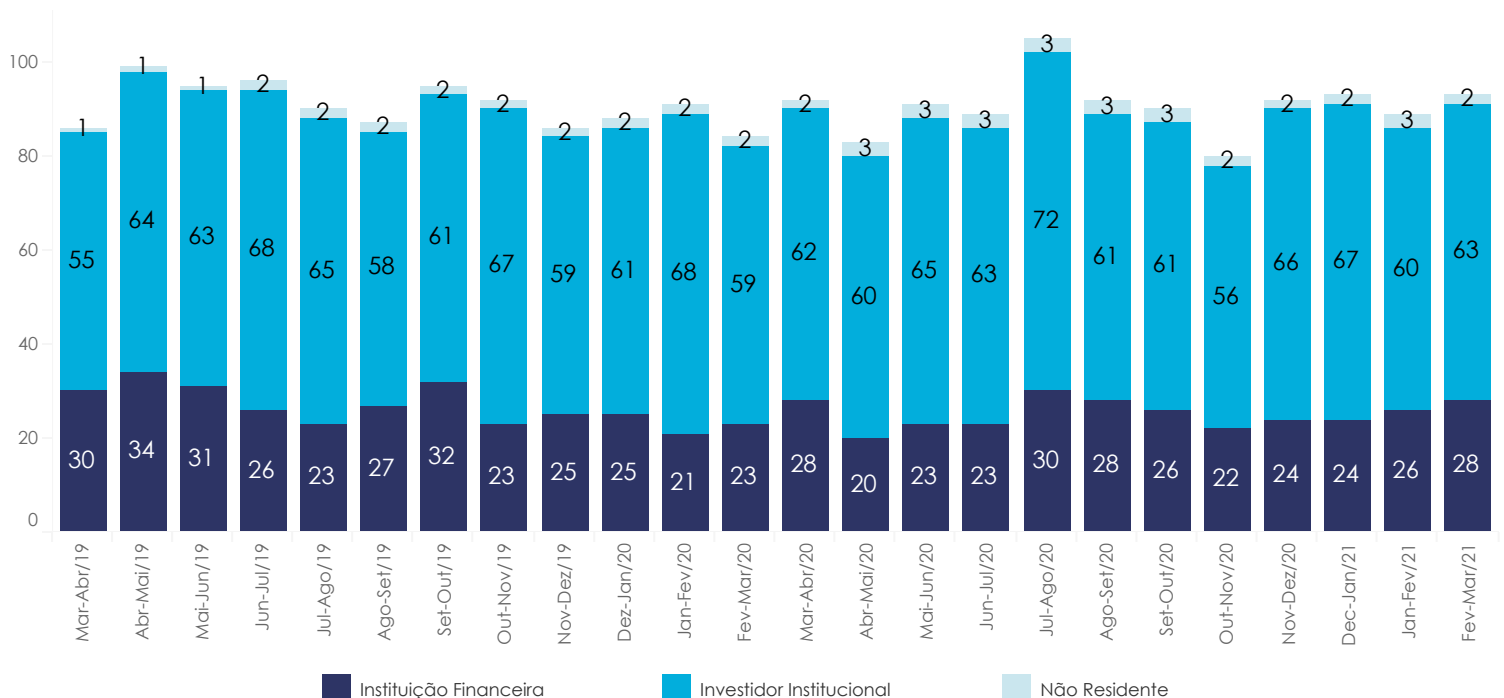


7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



8. Número de Instituições Negociando DAP



Contate-nos

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