

Informações Contratos Disponíveis

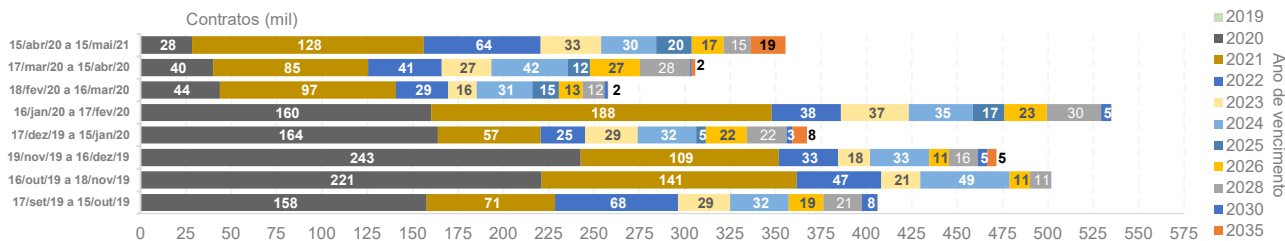
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPM20	WLM20 Index	15/06/2020	20	9,16%	99.306,82	0,96	0,77%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPN20	WLN20 Index	15/07/2020	42	6,30%	98.986,91	2,07	0,77%	
Tick Size	0,01%	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	65	4,88%	98.778,54	3,24	0,84%	
Lote padrão	5	DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	169	1,38%	99.085,06	8,74	1,36%	
Informações de Mercado		DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	251	1,29%	98.731,45	12,94	1,87%	
Data	15/05/2020	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	421	1,34%	97.800,76	21,49	2,51%	
DI	2,90%	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	566	1,71%	96.263,36	28,33	2,99%	
Dados de Inflação		DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	752	1,93%	94.455,16	36,85	3,97%	
Data início	15/04/2020	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.068	2,73%	89.212,51	49,05	5,17%	
Data fim	15/05/2020	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1.255	3,03%	86.186,40	55,52	5,84%	
DU Mês Total	20	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.573	3,50%	80.675,45	64,83	7,04%	
Índice Inflação Inicial	5.348,49	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.074	4,01%	72.355,12	76,28	8,76%	
1ª Prévía IPCA	09/04/2020	-0,04%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.574	4,37%	64.604,48	84,23	10,43%
2ª Prévía IPCA	28/04/2020	-0,21%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.767	4,70%	50.330,21	95,71	15,16%
IPCA IBGE	08/05/2020	-0,31%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.331,91									

*Por contrato

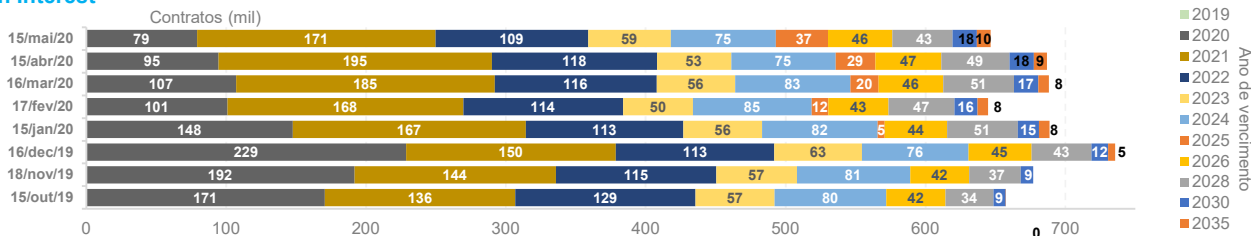
**Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



Open Interest

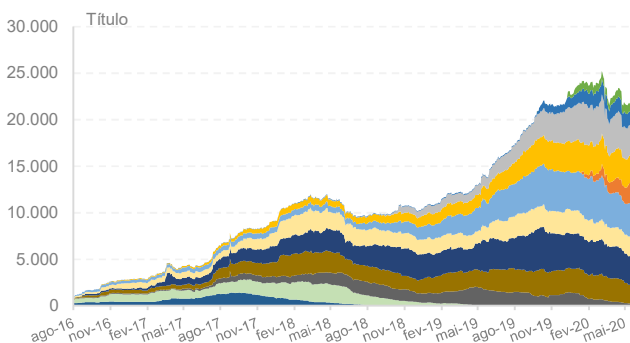


ADV (Contratos)

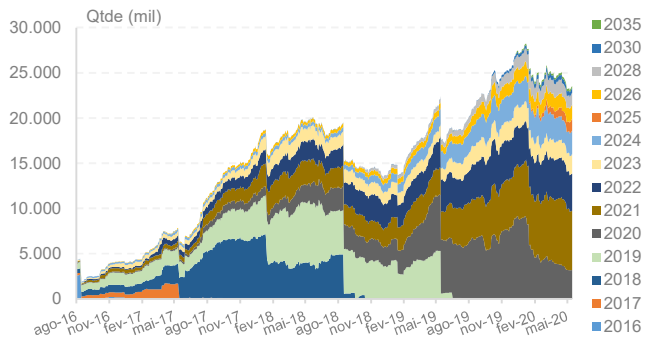


12.545 13.054 14.225 19.338 21.813 24.824 19.327 24.303 14.306 14.548 17.764

Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



Atualização: 15/maio/20

Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

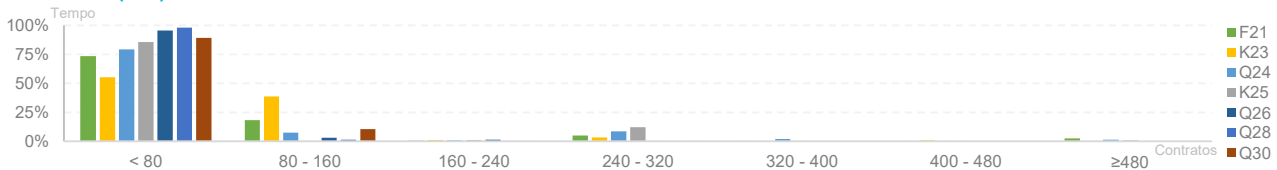
Formador de Mercado		Período de atuação	Vencimentos	Modelo A		Modelo B				Horários		
Modelo A	Modelo B			Camada 1		Camada 1*		Camada 2*				
				Spread Máximo	Quantidade e Mínima	Spread Máximo	Quantidade e Mínima	Spread Máximo	Quantidade e Mínima			
Itaú Santander	Mercury TMG Lakeside**	02/05/2020 a 14/07/2020	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	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		240		8 bps			60	3 bps
			ago/26	10 bps		60		8 bps			50	4 bps
			ago/28	15 bps		60		10 bps			40	4 bps
			ago/30	15 bps		100		13 bps			40	5 bps

*Atuação simultânea em ambas as camadas

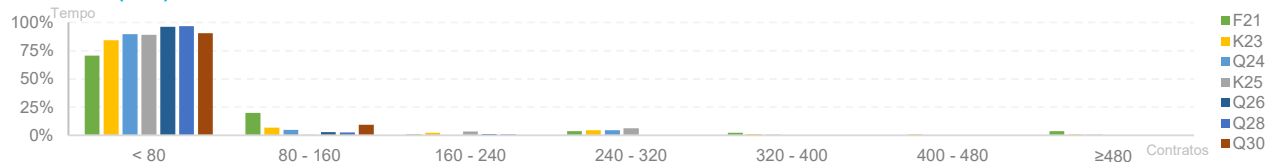
Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro de 04 a 15 de Maio

** Até 18/jun/2020

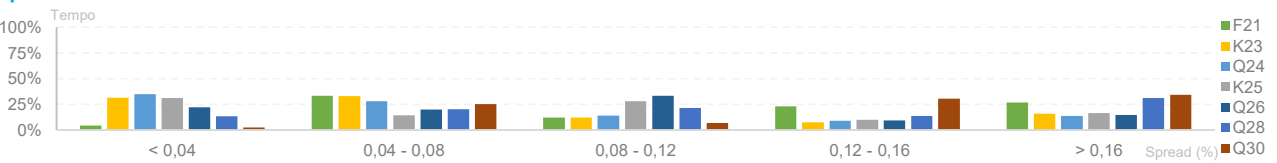
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

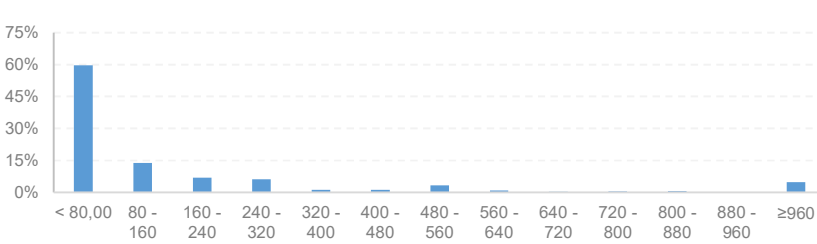


Spread Médio

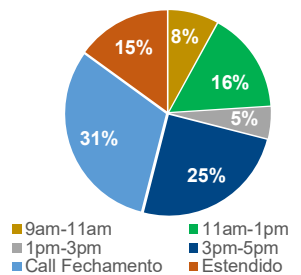


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

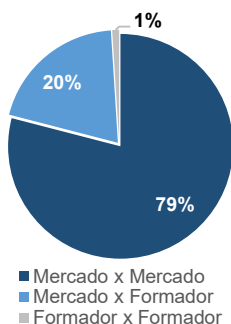


Por Janelas de Negociação

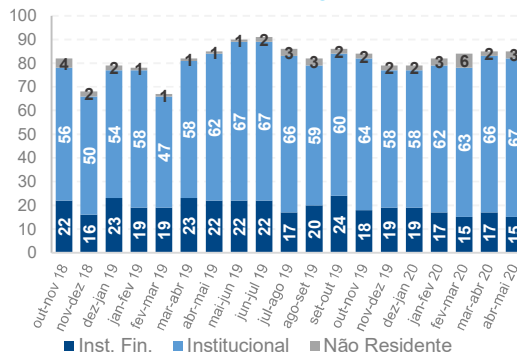


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

