

Informações Contratos Disponíveis

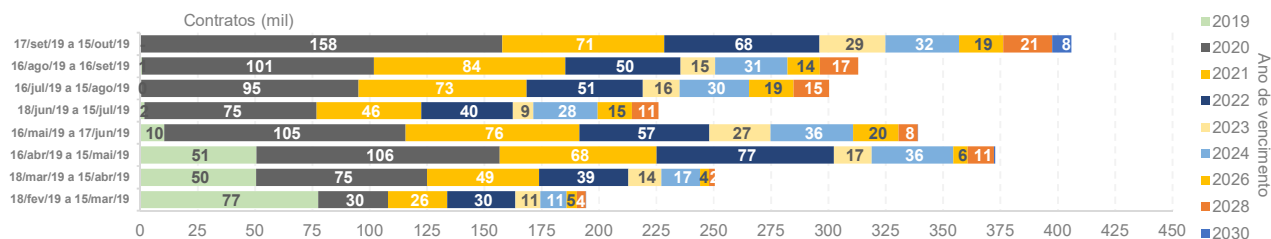
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**	
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPX19	WLX9 Index	18/11/2019	23	3,50%	99.686,51	1,15	0,72%	
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPZ19	WLZ9 Index	16/12/2019	43	2,58%	99.566,29	2,16	0,74%	
Tick Size	0,01%	DAPF20	WLF20 Index	15/01/2020	63	1,88%	99.535,45	3,19	0,80%	
Lote padrão	5	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	210	1,12%	99.076,15	10,67	1,61%	
Informações de Mercado		DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	314	1,13%	98.609,64	15,88	2,14%	
Data	15/10/2019	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	396	1,12%	98.265,01	19,96	2,42%	
DI	5,40%	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	711	1,65%	95.487,61	34,63	3,83%	
Dados de Inflação		DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	897	2,00%	93.193,90	42,50	4,60%	
Data início	17/09/2019	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.213	2,38%	89.295,50	54,85	5,77%	
Data fim	15/10/2019	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.718	2,78%	82.949,45	71,88	7,70%	
DU Mês Total	20	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.219	3,07%	76.623,68	85,52	9,54%	
Índice Inflação Inicial	5.229,93	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.719	3,24%	70.889,93	96,77	11,36%	
1ª Prévia IPCA	06/09/2019	0,10%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.912	3,53%	58.359,96	114,28	16,13%
2ª Prévia IPCA	24/09/2019	0,03%								
IPCA IBGE	09/10/2019	-0,04%								
Índice Pro-Rata Calculado	5.227,84									

*Por contrato

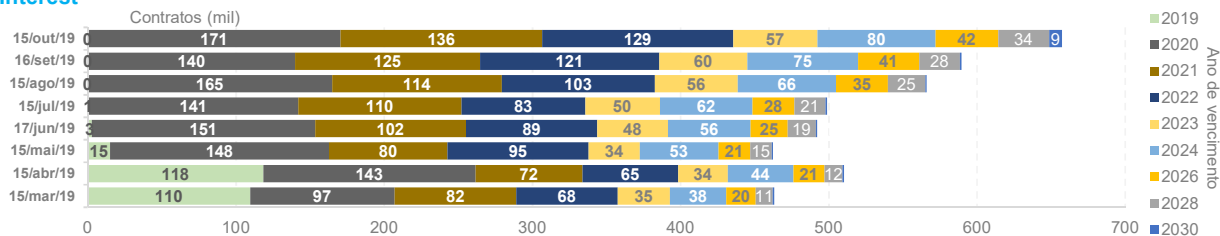
**Margem Teórica Máxima em % do PU

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

Contratos Negociados



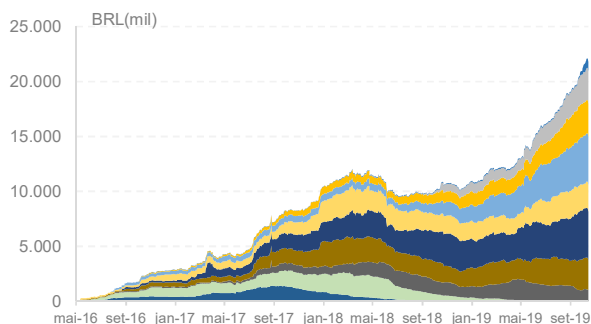
Open Interest



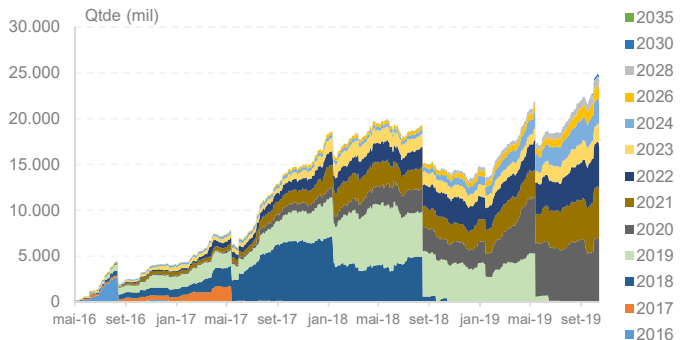
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



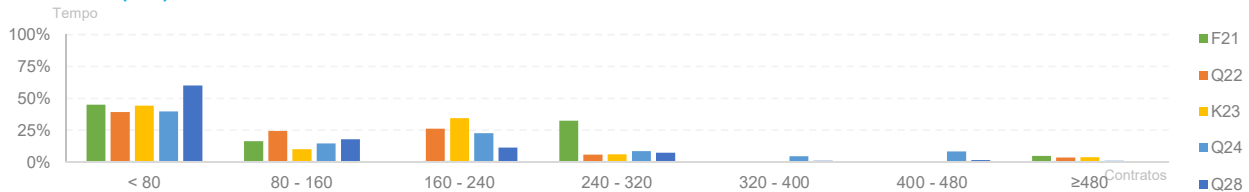
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

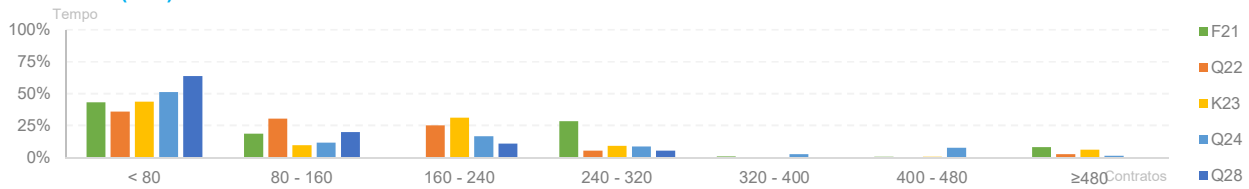
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/21 (F21), AGO/22 (Q22), MAI/23 (K23), AGO/24 (Q24) e AGO/28 (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo A*: 300 contratos (F21, Q22, K23 e Q24) e 160 contratos (Q28) na compra e na venda
- Spread Máximo *Modelo A*: 10 bps (F21, Q22, K23 e Q24) e 15 bps (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo B*: 120 contratos (F21), 100 contratos (Q22 e K23), 80 contratos (Q24) e 60 contratos (Q28)
- Spread Máximo *Modelo B*: 8 bps (F21 e Q24), 6 bps (Q22 e K23) e 13 bps (Q28)
- Presença em tela: Itaú, Santander, TMG e Mercury 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)

Vencimentos mais Líquidos - Informações do Topo do Livro em Agosto/19

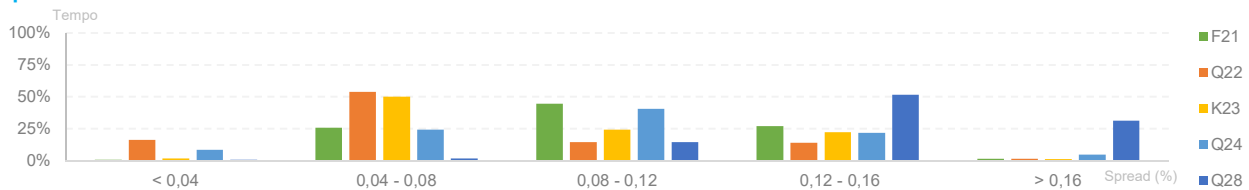
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

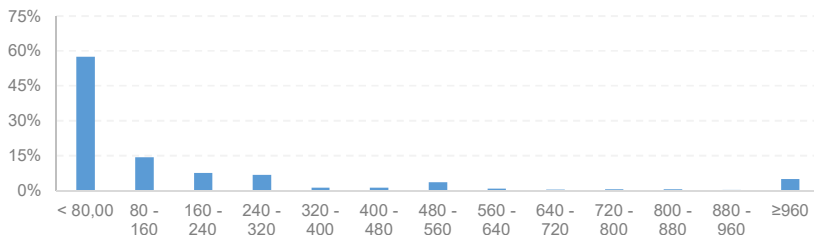


Spread Médio

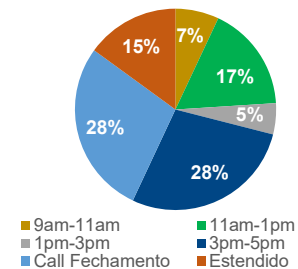


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

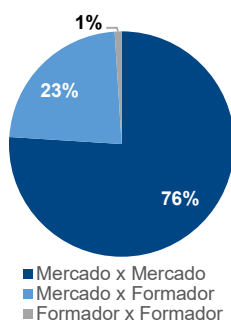


Por Janelas de Negociação

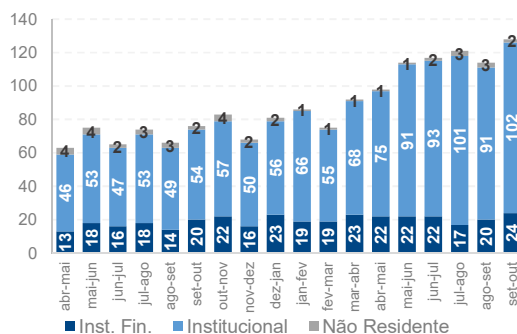


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

