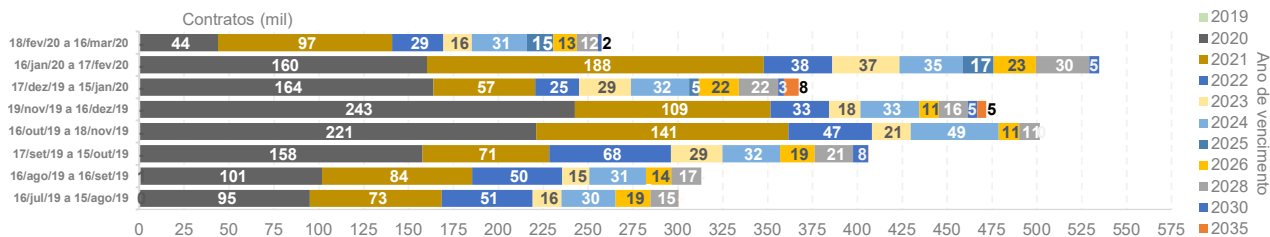


Informações Contratos Disponíveis

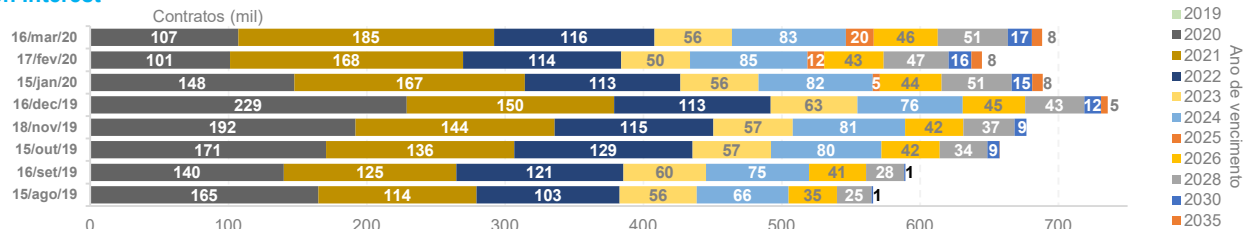
Especificações do Contrato		Cód. B3	Cód. BBG	Vcto	DU	Taxa	PU	BPV	Margem**
PU do Contrato (pontos)	100.000	DAPJ20	WLJ20 Index	15/04/2020	21	3,52%	99.712,13	1,07	0,72%
Valor do Ponto (BRL)	0,00025	DAPK20	WLK20 Index	15/05/2020	41	2,94%	99.529,67	2,10	0,74%
Tick Size	0,01%	DAPM20	WLK20 Index	15/06/2020	61	2,88%	99.315,06	3,12	0,82%
Lote padrão	5	DAPQ20	WLQ20 Index	17/08/2020	106	2,70%	98.885,60	5,41	1,01%
Informações de Mercado		DAPF21	WLF21 Index	15/01/2021	210	1,28%	98.945,70	10,88	1,62%
Data	16/03/2020	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	292	1,09%	98.751,67	15,12	2,05%
DI	4,15%	DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	462	1,60%	97.131,82	23,42	2,61%
Dados de Inflação		DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	607	1,98%	95.387,10	30,10	3,22%
Data início	17/02/2020	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	793	2,43%	92.723,01	38,06	4,13%
Data fim	16/03/2020	DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	1.109	2,95%	87.990,15	50,24	5,33%
DU Mês Total	18	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1.296	3,24%	84.875,38	56,48	6,02%
Índice Inflação Inicial	5.331,42	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1.614	3,53%	80.076,39	66,17	7,22%
1ª Prévía IPCA 07/02/2020	0,14%	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	2.115	3,89%	72.593,70	78,33	9,08%
2ª Prévía IPCA 20/02/2020	0,15%	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2.615	4,02%	66.432,21	88,50	10,74%
IPCA IBGE 11/03/2020	0,25%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3.808	4,32%	52.777,10	102,07	15,57%
Índice Pro-Rata Calculado	5.344,75	*Por contrato		**Margem Teórica Máxima em % do PU					

Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

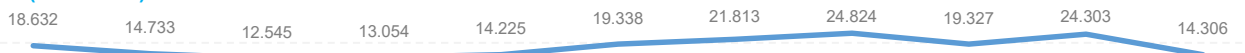
Contratos Negociados



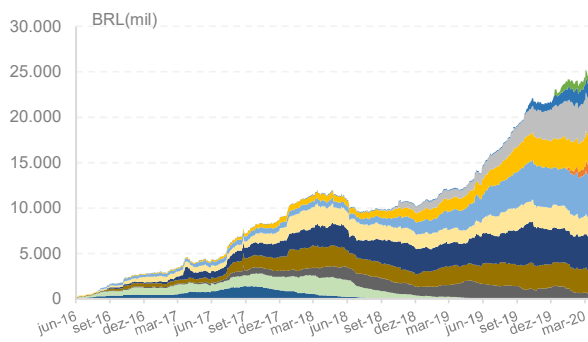
Open Interest



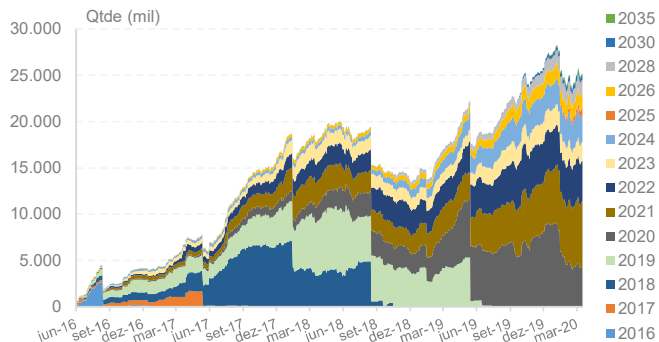
ADV (Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



Atualização: 16/março/20

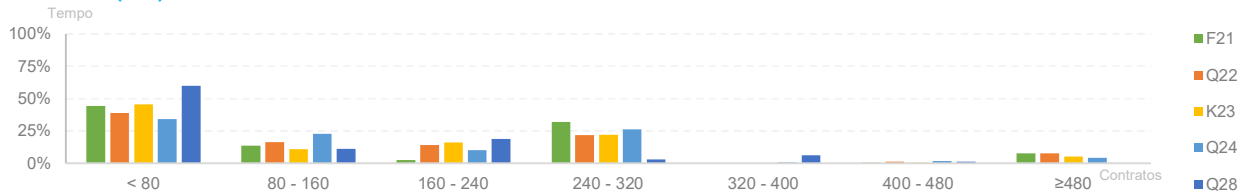
Programa de Formador de Mercado

Obrigações do Formador de Mercado

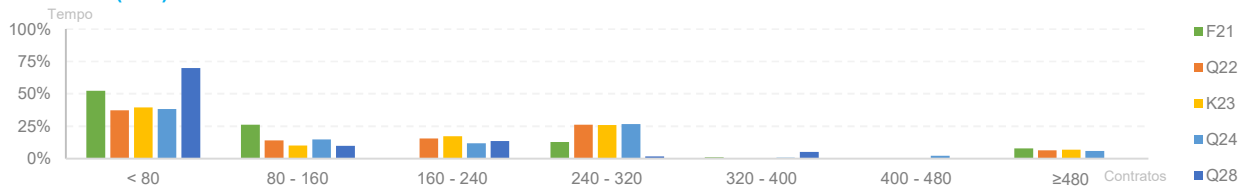
- Vencimentos Obrigatórios: JAN/21 (F21), AGO/22 (Q22), MAI/23 (K23), AGO/24 (Q24) e AGO/28 (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo A*: 300 contratos (F21, Q22, K23 e Q24) e 160 contratos (Q28) na compra e na venda
- Spread Máximo *Modelo A*: 10 bps (F21, Q22, K23 e Q24) e 15 bps (Q28)
- Lote Mínimo *Modelo B*: 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 Fevereiro/20

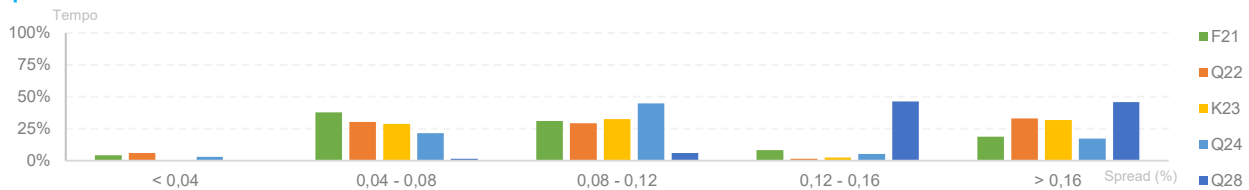
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

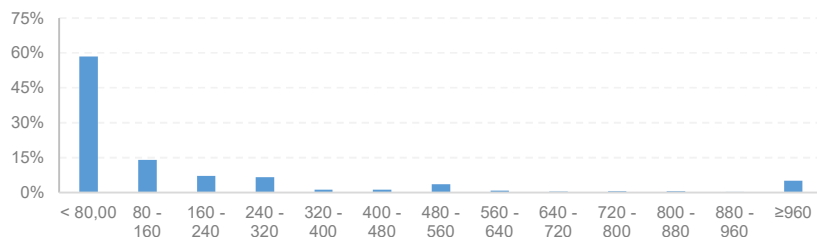


Spread Médio

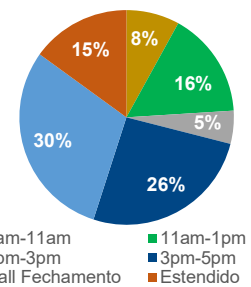


Frequência de Execução de Ordens

Por Lote Executado

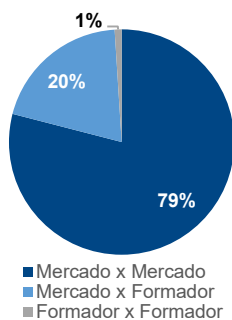


Por Janelas de Negociação

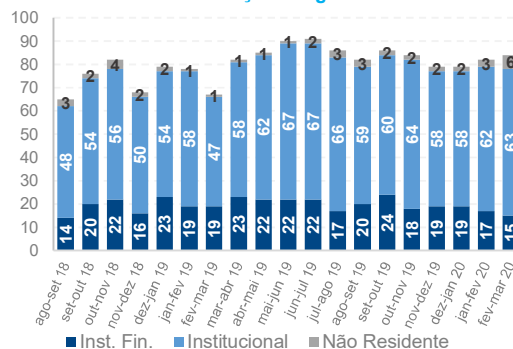


Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



Número de Instituições Negociando DAP



Negociação em Tela

Diretos Intencionais

