

CONTRATO FUTURO DE CUPOM DE IPCA

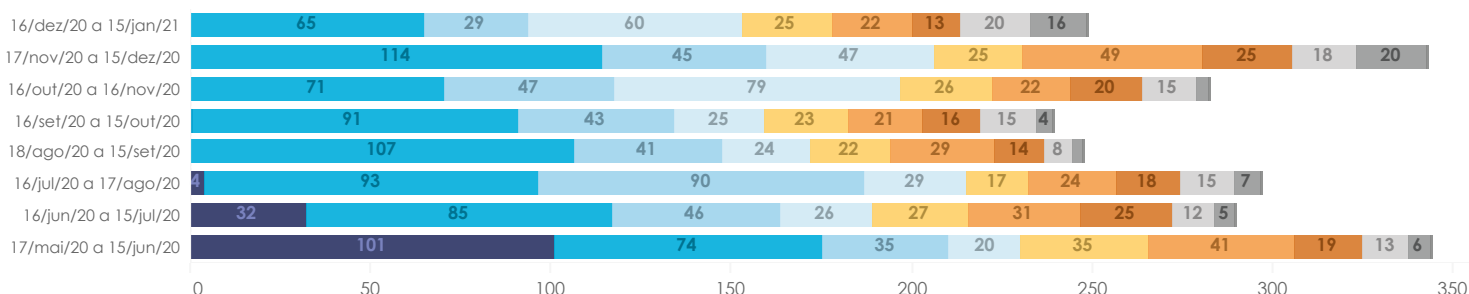
1. Informações dos Contratos Disponíveis

ESPECIFICAÇÕES DO CONTRATO		Código B3	Código Bbg	Vencimento	DU	Taxa	PU	BPV*	Margem**
PU DO CONTRATO (PONTOS)	100.000	DAPG21	WLG21 Index	17/02/2021	21	0,43%	99.964	1,11	0,69%
VALOR DO PONTO (BRL)	0,00025	DAPH21	WLH21 Index	15/03/2021	39	-1,62%	100.253	2,11	0,69%
TICK SIZE	0,01%	DAPJ21	WLJ21 Index	15/04/2021	61	-1,78%	100.436	3,31	0,83%
LOTE PADRÃO	1	DAPK21	WLK21 Index	17/05/2021	82	-2,20%	100.726	4,48	0,93%
INFORMAÇÕES DE MERCADO		DAPF22	WLF22 Index	17/01/2022	252	-0,77%	100.776	13,57	1,92%
DATA	18/01/2021	DAPQ22	WLQ22 Index	15/08/2022	397	0,14%	99.780	20,97	2,47%
DI	1,90%	DAPK23	WLK23 Index	15/05/2023	583	1,08%	97.545	29,82	3,08%
DADOS DE INFLAÇÃO		DAPQ24	WLQ24 Index	15/08/2024	899	1,87%	93.604	43,78	4,54%
DATA INÍCIO	16/12/2020	DAPK25	WLK25 Index	15/05/2025	1086	2,13%	91.317	51,47	5,26%
DATA FIM	15/01/2021	DAPQ26	WLQ26 Index	17/08/2026	1404	2,59%	86.722	62,90	6,39%
DU MÊS TOTAL	19	DAPQ28	WLQ28 Index	15/08/2028	1905	3,05%	79.683	78,06	8,23%
ÍNDICE INFLAÇÃO INICIAL	5.486,52	DAPQ30	WLQ30 Index	15/08/2030	2405	3,28%	73.491	90,68	9,92%
1ª PRÉVIA IPCA	08/12/2020 1,26%	DAPK35	WLK35 Index	15/05/2035	3598	3,67%	59.773	109,90	14,48%
2ª PRÉVIA IPCA	22/12/2020 1,21%	DAPQ40	WLQ40 Index	15/08/2040	4920	4,09%	45.720	114,46	20,05%
IPCA IBGE	12/01/2021 1,35%	DAPK45	WLK45 Index	15/05/2045	6111	4,44%	34.872	108,05	25,14%
ÍNDICE PRO-RATA CALCULADO	5.560,59								

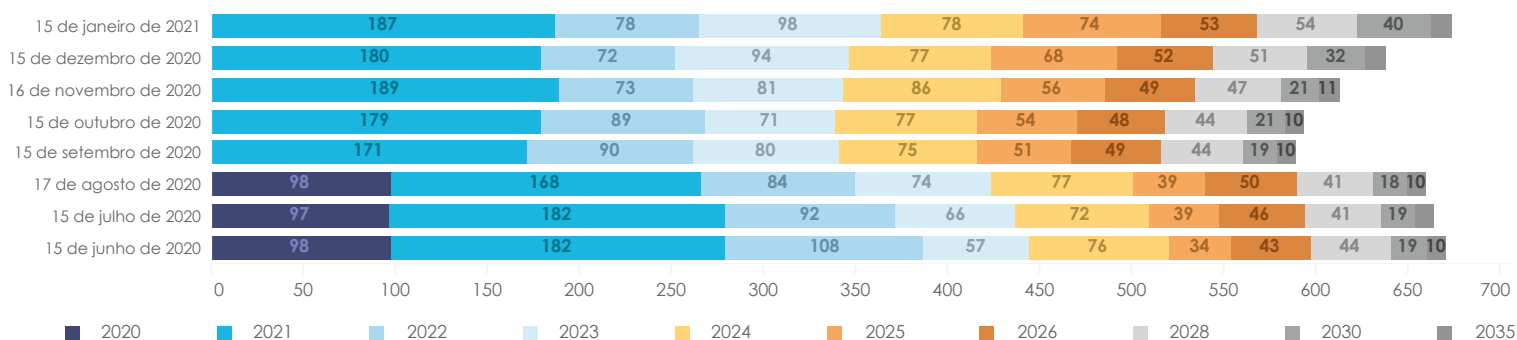
*Por contrato **Margem Teórica Máxima em % do PU

2. Negociação Pós Programa de Formador de Mercado

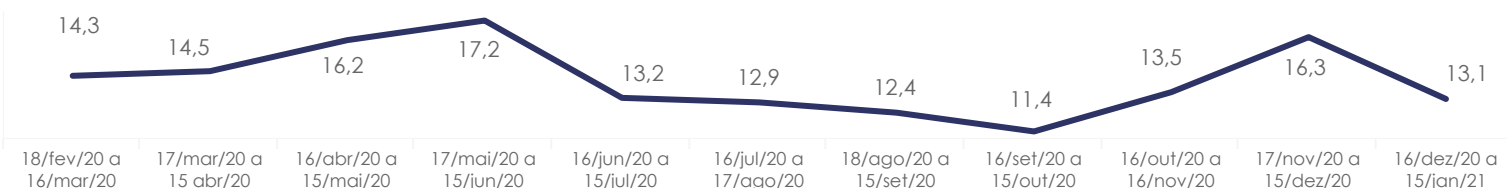
Contratos Negociados (em Milhares)



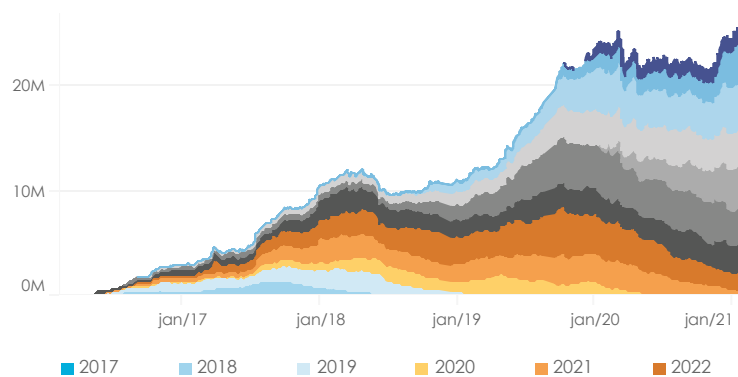
Open Interest (em Milhares)



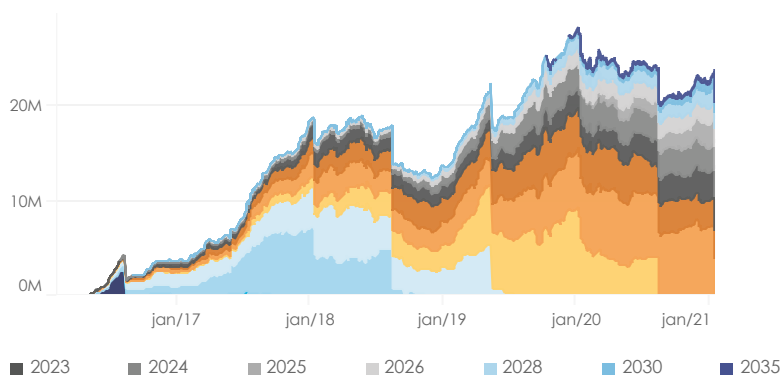
ADV (em Milhares de Contratos)



Open Interest em DV01 Equivalente



Open Interest em NTN-B Equivalente



3. Programa de Formador de Mercado

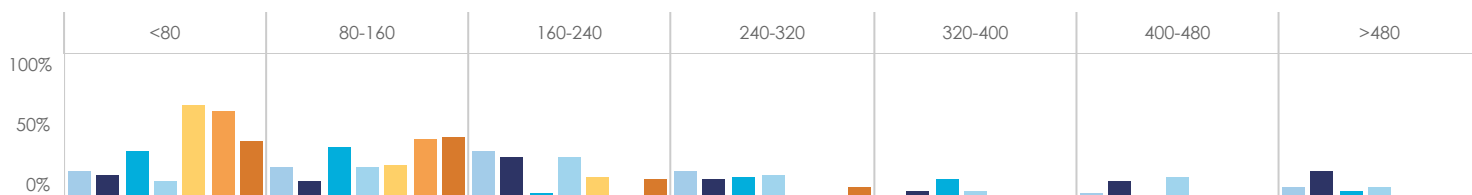
Obrigações do Formador de Mercado

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		100	8 bps	3 bps					
		15/04/2021 a 30/04/2021		14 bps			5 bps						
		02/05/2020 a 30/04/2021	mai/23	10 bps		60	6 bps	80			3 bps		
			ago/24				60					8 bps	50
			mai/25									15 bps	
			ago/26			60	13 bps	5 bps					
ago/28	100		5 bps										
ago/30	100	13 bps	5 bps										

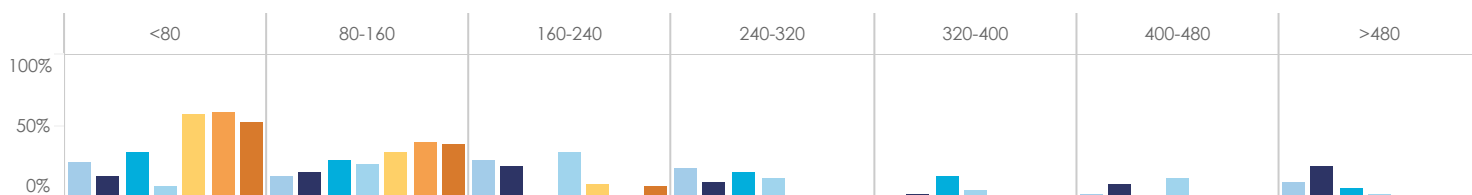
4. Vencimentos Mais Líquidos

Informações do Topo do Livro (16/12 a 15/01)

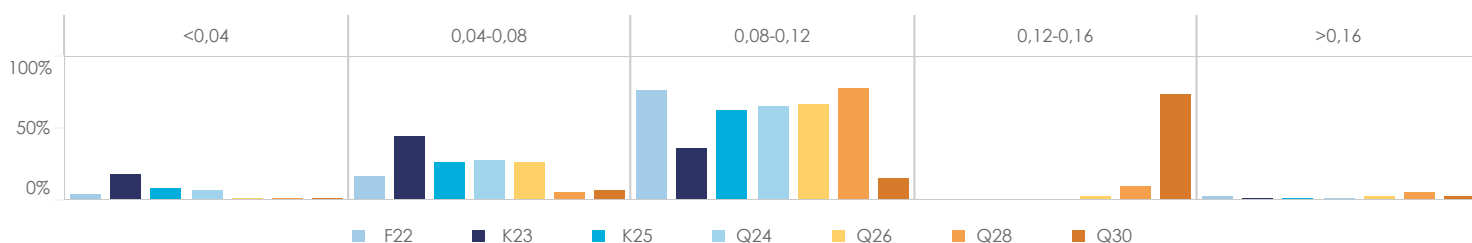
Lote Médio (Bid)



Lote Médio (Ask)

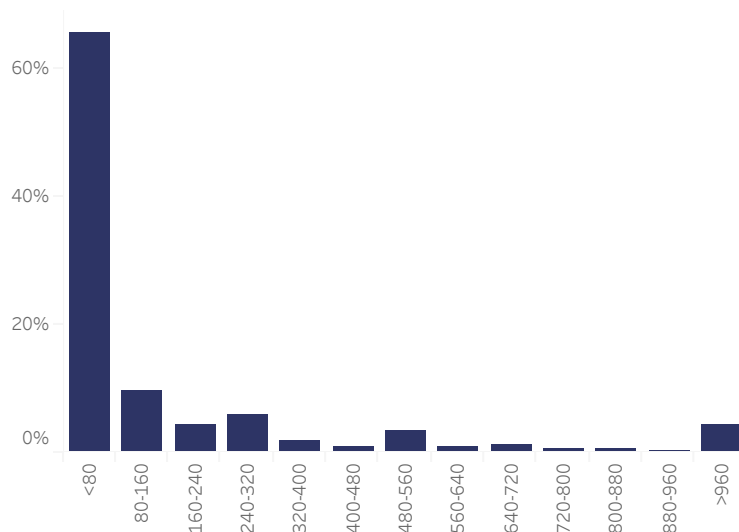


Spread Médio

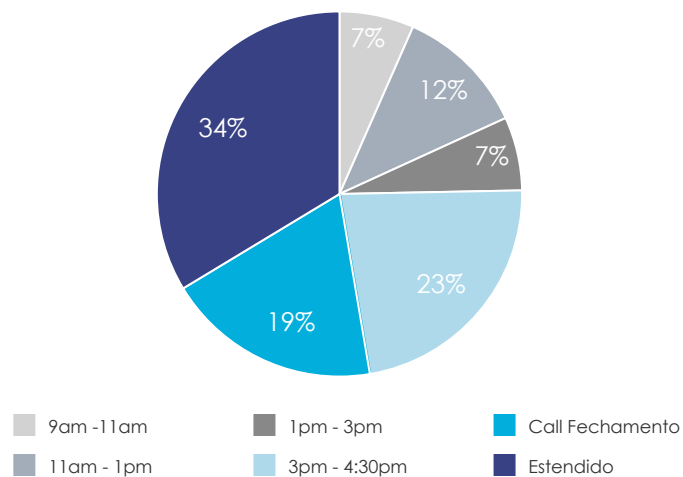


5. Frequência de Execução das Ordens

Por Lote Executado

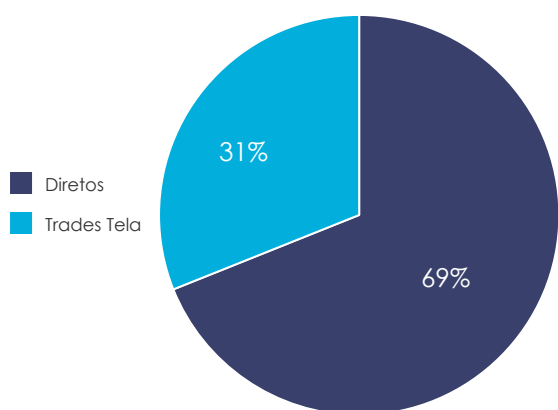


Por Janela de Negociação



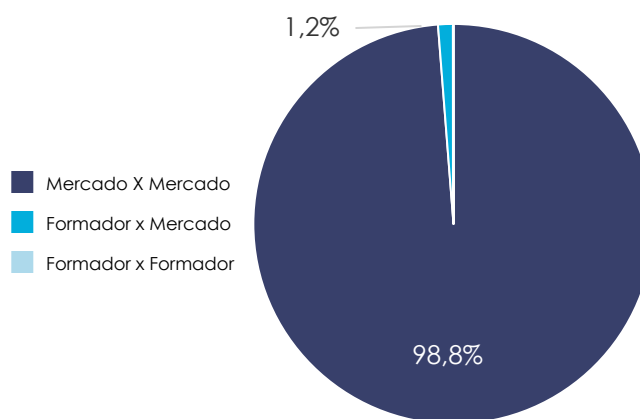
6. Negociação em Tela

Diretos Intencionais

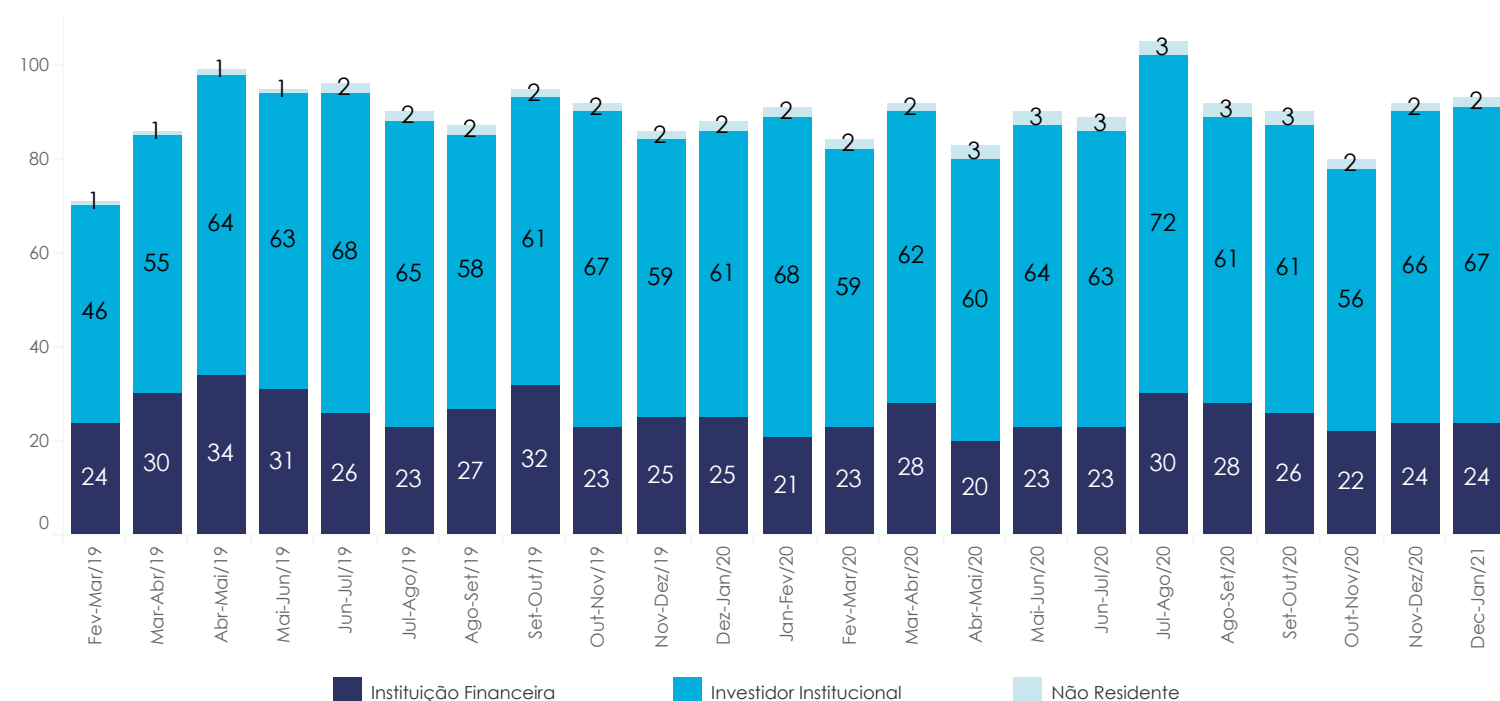


7. Participação por Tipo de Investidor

Breakdown Participação FM



8. Número de Instituições Negociando DAP



Contate-nos

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