

Parâmetros de Atuação do Formador de Mercado de Futuro de Cupom de IPCA (DAP)

Os formadores de mercado credenciados neste programa deverão realizar ofertas de compra e de venda, respeitando os seguintes parâmetros de atuação:

Vértices	Spread Máximo (bps)	Lote mínimo (contratos)	Período de Atuação
Q24	20	40	De 10/06/24 até 14/06/24
F25	10		De 10/06/24 até 14/06/24
	20		De 17/06/24 até 14/11/24
K25	10		De 10/06/24 até 13/12/24
	20		De 16/12/24 até 14/03/25
F26	6		De 10/06/24 até 14/01/25
	10		De 15/01/25 até 31/03/25
Q26	6		100
K27			
Q28			
K29			
Q30			
Q32			
K33		75	
K35			
Q40			
Q50			50

Horários de atuação dos vencimentos obrigatórios

- **Entre 09h e 18h:** 70% do período, durante 100% dos dias do mês em que houver sessão de negociação.

Vigência a partir de: 10 de junho de 2024

Meta do pool

- Definido de acordo com a tabela:

Mês	Meta
Junho/24	100.000 contratos ponderados
Julho/24	
Agosto/24	
Setembro/24	
Outubro/24	
Novembro/24	
Dezembro/24	
Janeiro/25	
Fevereiro/25	
Março/25	

ADV mínimo

- Definido de acordo com a tabela:

Mês	Meta
Junho/24	3.000 contratos ponderados
Julho/24	
Agosto/24	
Setembro/24	
Outubro/24	
Novembro/24	
Dezembro/24	
Janeiro/25	
Fevereiro/25	
Março/25	

Ponderação do ADV: Todo ADV avaliado no programa é ponderado pelo prazo mediante a seguinte tabela:

Prazo do contrato	Peso
Até 2024	1
De 2025 a 2030	4
Acima de 2030	8

Última atualização: 26/06/2024

A meta inicial do pool parte de um ADV simples de 24.000 contratos, que foram ponderados pelo prazo de acordo com as quantidades médias negociadas hoje em cada faixa.

Registro de alterações:

Ativo	Modificação	Data da alteração