

Risk Management – Published Parameters	
7.4.1 Definição da estratégia de encerramento na metodologia CORE	
17) Data máxima do prazo de encerramento	D+10
18) Transição de liquidez	
Contrato futuro de DOL	1
Contrato futuro de WDO	1
Contrato futuro de DDI	2
Demais contratos	Não se aplica
19) Número de vencimentos com transição de liquidez	
Contrato futuro de DOL	1
Contrato futuro de WDO	1
Contrato futuro de DDI	1
Demais contratos	Não se aplica
20) Dia de Rolagem	Nenhuma operação de rolagem será incluída
7.4.2 Estratégias de encerramento para diferentes conjuntos de posições	
7.4.2.7 Estratégia de encerramento do tipo otimizado	
21) Principal fator de risco - taxa de câmbio entre dólar dos EUA e real (dólar à vista)	
Conjuntos de instrumentos e ativos com exposição relevante ao principal fator de risco	Contratos futuros de DOL, WDO, DDI e DCO e swaps cambiais de SCS
Instrumento de imunização para operações de imunização	Instrumento de contrato futuro de DOL 1º vencimento
Conjuntos de instrumentos encerráveis via operações estruturadas	Nenhuma operação estruturada será incluída
Conjuntos de instrumento com rolagem	Nenhuma operação de rolagem será incluída
22) Principal fator de risco - taxa de juros pré-fixada em reais	
Conjuntos de instrumentos e ativos com exposição relevante ao principal fator de risco	Contrato futuro de DI1
Instrumento de imunização para operações de imunização	Nenhuma operação de imunização será incluída
Conjuntos de instrumentos encerráveis via operações estruturadas	Nenhuma operação estruturada será incluída
Conjuntos de instrumento com rolagem	Nenhuma operação de rolagem será incluída