



Política de Risco de Mercado

Elaboração: Riscos

Aprovação: Riscos/Diretoria

Versão: 4

Código: P007

Vigente Desde: 03/2015

Última Versão: 05/2020

ÍNDICE

1. OBJETIVO	2
2. APLICABILIDADE.....	2
3. DIRETRIZES.....	2

1. OBJETIVO

Este documento estabelece as diretrizes relacionadas à estrutura e ao processo de risco de mercado.

2. APLICABILIDADE

Os dispositivos deste documento são aplicáveis a todas as empresas do Grupo BR Partners.

3. DIRETRIZES

3.1. Assegurar a devida segregação de funções, responsabilidades e delegação de autoridade em todo o processo de gerenciamento de risco de mercado.

3.2. Assegurar que a análise do risco de mercado seja feita de forma independente e técnica, considerando-se adicionalmente as características das operações e produtos.

3.3. Garantir a existência e cumprimento dos processos estruturados de análise e aprovação dos limites de risco de mercado.

3.4. Garantir que os limites de risco de mercado sejam devidamente aprovados antes da realização das operações.

3.5. Garantir um processo contínuo de monitoramento dos riscos de mercado.

3.6. Definir os níveis aceitáveis de risco de mercado.

3.7. Definir a correta classificação dos fatores de risco das operações tal que reflitam seu real risco de mercado.

3.8. Definir a metodologia de *pricing* das operações, produtos e estratégias.

3.9. Assegurar a existência e garantir o aperfeiçoamento e monitoramento dos processos, modelos e ferramentas utilizados no gerenciamento de risco de mercado.