

Resumo de Estrutura de Gerenciamento do Risco de Mercado

A Federalcred Ceará em cumprimento à Resolução CMN 3.464 de 26 de junho de 2007, implementou sua estrutura de Gerenciamento do Risco de Mercado.

A estrutura, gerenciamento e a execução da política de Gerenciamento do Risco de Mercado da Federalcred Ceará encontram-se no Manual de Gerenciamento do Risco de Mercado (em elaboração).

A estrutura de Gerenciamento do Risco de Mercado da Federalcred Ceará compreende papéis e responsabilidades que permitem o adequado gerenciamento de risco. Para tanto, está composta pelo Conselho de Administração, Diretoria Executiva, Diretor Responsável, Agente de Controle Interno.

As ferramentas de controle do Gerenciamento do Risco de Mercado são relatórios semestrais de mapeamento e exposição à risco.

Os papéis e as responsabilidades dos componentes da estrutura de Gerenciamento do Risco de Mercado da Federalcred Ceará seguem descritos abaixo:

Conselho de Administração:

- I) Definir, aprovar, atualizar, revisar e disseminar a política de Gerenciamento do Risco de Mercado;
- II) Estabelecer as responsabilidades dos componentes da estrutura;

Diretoria Executiva:

- I) Analisar os relatórios e atuar nas correções de deficiências;
- II) Indicar o diretor responsável pelo Gerenciamento do Risco de Mercado.

Diretor Responsável:

- I) Administrar a política de Gerenciamento do Risco de Mercado;
- II) Revisar, aprovar e encaminhar o Relatório do Risco de Mercado à Diretoria Executiva.

Agente de Controle Interno:

- I) Identificar, avaliar, monitorar, controlar, e mitigar o risco de mercado;
- II) Elaborar, com periodicidade mínima anual, relatórios que permitam identificar e corrigir tempestivamente as deficiências de controle e de gerenciamento do risco de mercado;
- III) Elaborar e disseminar a política de gerenciamento de risco de mercado ao pessoal da instituição, em seus diversos níveis, estabelecendo papéis e responsabilidades, bem como as dos prestadores de serviços terceirizados;
- IV) Identificar previamente os riscos inerentes a novas atividades e produtos, analisar sua adequação aos procedimentos e controles adotados pela instituição;
- V) Realizar simulações de condições extremas de mercado (testes de estresse), inclusive da quebra de premissas, cujos resultados devem ser considerados ao estabelecer ou rever as políticas e limites para a adequação de capital.

Antonio Martins Moreira
Diretor Presidente

Fernando César de Oliveira Mota
Diretor Operacional