

MRA – INFORMAÇÕES QUALITATIVAS SOBRE O GERENCIAMENTO DE RISCO DE MERCADO - 2020

Devem as políticas do gerenciamento do risco de mercado, conforme estabelecido na Resolução nº 4.557, de 2017, destacando:		
(a)	<p>Estratégias e processos utilizados no gerenciamento do risco de mercado. Devem ser divulgados: • os objetivos estratégicos relacionados às operações sujeitas ao risco de mercado; • os processos para identificar, medir, monitorar e controlar esse risco, incluindo as políticas associadas às estratégias de proteção(hedge), bem como o monitoramento da efetividade destas.</p>	<p>A estratégia da área da Tesouraria do BSGB tem como finalidade a oferta de produtos de câmbio, proteção e investimento para os clientes com recursos obtidos através de funding recebido da matriz SGParis / captação no mercado local (CDBs e CDIs). Na Tesouraria as atividades são segregadas entre a Mesa de Vendas (Sales Desk) e a Mesa Market Making (Market Making Desk). A atividade principal da Mesa Market Making é o fornecimento de preços competitivos para atender às necessidades da Mesa de Vendas; eventuais riscos remanescentes desta atividade devem respeitar os limites estabelecidos de risco de mercado. A Mesa de Vendas tem como atividades principais o relacionamento e oferta dos produtos para Clientes. A área, dentro das diretrizes do BSGB, não toma exposição ao risco de mercado e trabalha no modelo de definição de spread das operações comerciais. A estratégia de proteção das posições (hedge) é feita através de instrumentos Derivativos, transacionados através da Brasil Bolsa Balcão (B3). Para o gerenciamento de risco de mercado são previstos os procedimentos de identificação, avaliação, monitoramento, controle, mitigação e comunicação das informações de risco. Estes procedimentos são executados de forma independente pela unidade de Risco de Mercado e estão em conformidade com a estratégia global do Banco Société Générale Brasil para suas linhas de negócios. A área de Risco de Mercado no BSGB utiliza, para gerenciamento das exposições da Tesouraria, metodologias e modelos condizentes com a realidade do mercado nacional e internacional, permitindo embasar as decisões estratégicas da instituição com agilidade, transparência e alto grau de confiança. Os relatórios de risco de mercado são ferramentas essenciais para a divulgação das informações relativas às métricas de riscos (como VaR, DV10, Stress Testing, etc.) além da verificação do consumo e acompanhamento de utilização dos limites. O formato e a frequência dos relatórios de risco de mercado são definidos de acordo com as exigências dos órgãos reguladores locais e seguem definições das áreas de risco globais e locais. Todas as alterações e inclusões nos relatórios de risco de mercado devem ser aprovadas pelos membros do Comitê de Riscos de Mercado e Liquidez. O BSGB possui uma base de dados única e central. Este banco de dados é alimentado diariamente por todas as operações contidas em cada um dos sistemas BackOffice, além do sistema de boletagem das operações. Esta base de dados contém todas as posições que impactam a análise de risco de mercado. Uma vez que as posições estão atualizadas na base de dados, elas são integradas no sistema local de risco. Para os produtos migrados para os sistemas globais a base de dados é alimentada pelo sistema de boletagem global, que posteriormente alimenta os sistemas global e local de risco de mercado.</p>
(b)	<p>Estrutura responsável pela implementação das estratégias e processos empregados no gerenciamento do risco de mercado, incluindo os mecanismos de comunicação interna utilizados.</p>	<p>Informações consolidadas em Estratégias e Processos.</p>
(c)	<p>Principais características dos sistemas de informação e de mensuração dos riscos.</p>	<p>Informações consolidadas em Estratégias e Processos.</p>