

## Risco de Mercado

### DESCRIÇÃO DA ESTRUTURA DE GERENCIAMENTO DE RISCOS DE MERCADO

A Prime Corretora, atendendo a Resolução CMN 3464, implementou sua Política de Gerenciamento de Risco de Mercado. A Política visa evidenciar a estrutura do gerenciamento e estabelecer responsabilidades, ferramentas, relatórios e procedimentos.

**Diretoria Colegiada** - Responsável pela aprovação da Política de Gerenciamento de Riscos de Mercado, por assegurar que a estrutura está devidamente implantada e é apropriada para suas atividades.

**Diretoria Responsável por Riscos de Mercado** - Diretor indicado a representar a Corretora junto ao Banco Central, responsável por definir as políticas e objetivos gerais e respaldar a Alta Administração com informações relevantes sobre a implantação e gerenciamento dos riscos de mercado.

**Gestor Responsável por Riscos de Mercado** - Colaborador designado pelo Diretor Responsável para implantar e gerenciar a estrutura de gerenciamento de riscos operacionais e os seus principais componentes relacionados ao ambiente, avaliação de riscos, atividades, monitoramento e correção de deficiências, bem como o processo de informação e comunicação, em unidade específica e exercendo suas funções de forma segregada daquelas relacionadas à auditoria interna prevista na Resolução CMN 2554/98.

A estrutura de Gerenciamento de Risco de Mercado abrange os procedimentos necessários para efetivo cumprimento das políticas estabelecidas e possui as seguintes atribuições:

1. Identificar, medir e controlar o Risco de Mercado de todas as operações da Corretora
2. Acompanhar os limites operacionais de Risco de Mercado
3. Determinar as fontes de preços de mercado e zelar pela adequação das mesmas, de forma independente das áreas de gestão;
4. Estabelecer as metodologias de apuração dos ativos;
5. Monitorar a liquidez dos ativos e passivos em carteira.

O controle de Risco de Mercado é baseado no cálculo do VaR - Value at Risk, uma ferramenta estatística que mede a perda potencial máxima da Corretora com 95% de confiança, em um horizonte de investimento de um dia.

Caso o limite de VaR venha a ser extrapolado, o Diretor Responsável deve tomar medidas para realizar o reenquadramento o mais rápido possível, utilizando-se dos instrumentos financeiros necessários. Não existe alçada que permita a possibilidade de desenquadramento dos limites de risco.

Assim, a Corretora em cumprimento as disposições da Resolução CMN 3464, gerencia seus Riscos de Mercados em consonância com as disposições regulamentares e as melhores práticas do mercado.

A Diretoria Colegiada da Prime Corretora está engajada no processo de definição da sua Política de Gerenciamento de Riscos. Dessa forma, a Prime disponibiliza adequados recursos humanos e materiais, além de divulgar informações que se fazem necessárias aos clientes e colaboradores em seu site na rede mundial de computadores.

Carlos Alberto Reis      Juan Carbonell Ros  
Diretor                                  Diretor