

METODOLOGIA DA GESTÃO DE RISCOS

A gestão de risco será realizada através de ferramentas desenvolvidas internamente. A carteira do gestor será disponibilizada eletronicamente, e o Diretor de Risco e Compliance avaliará a posição consolidada e o risco diário.

Rotina de controle de risco:

1. Regularmente, a carteira do fundo (enviada pelo administrador) será inserida no sistema proprietário, onde serão calculados os riscos e exposições do fundo.
2. Será verificado se o fundo está de acordo com os limites estabelecidos pelo mandato.
3. Caso haja desacordo com o regulamento/mandato, o Gestor deverá enquadrar as posições em tempo hábil.
4. Ao final da análise, será gerado um relatório de risco com os cálculos das medidas de riscos e exposição de classes de ativos e resultado das operações.
5. Periodicamente também será testada a sensibilidade da carteira a mudanças bruscas em variáveis macroeconômicas a fim de evitar exposição excessiva em tais eventos.

Além disso, utilizar-se-á para a gestão de risco dos fundos o VaR histórico e paramétrico, a gestão de liquidez de acordo com o passivo do fundo, e os limites determinados pelo comitê de investimentos em exposições por empresa, por setor e/ou a eventos macroeconômicos.

Marcelo Goldsztejn

Diretor de Risco e Compliance

Copacabana Gestão de Recursos Financeiros Ltda.
Av Copacabana 325, Conj. 1518
Empresarial 18 do Forte – Barueri
06472-001 – Alphaville
Tel.: (11) 99216-9122
daniel@copacabanainvest.com.br