

A gestão de riscos é uma das nossas prioridades, representando uma importante ferramenta para o fortalecimento da governança e da administração dos ativos investidos. Dentro dessa diretriz, recentemente, revisamos a Política de Gestão de Riscos, que estabelece os princípios que norteiam a estratégia no controle e gerenciamento dos riscos financeiros e atuariais dos planos de benefícios. As alterações no documento refletem os ajustes implementados para reforçar os controles da gestão dos investimentos. Uma das novidades é que a Petros passou a contar com um modelo próprio de apetite a risco, que define uma estrutura de limite de riscos para cada plano de benefícios, de acordo com a característica do seu passivo.

As mudanças na gestão de riscos da Petros ganharam ainda mais peso estratégico a partir de junho de 2020, com a incorporação da atividade no escopo da Diretoria de Riscos, Administração e Finanças, comandada por Leonardo Moraes. “O aprimoramento da gestão de riscos se une a mudanças instituídas na Petros para fortalecer os controles internos, compliance, práticas de transparência e elevar nosso padrão de governança”, destaca o diretor.

Com a revisão da política, também foram definidos com maior clareza papéis e responsabilidades de todos os agentes que participam deste processo, desde a alta governança – Conselho Deliberativo, Conselho Fiscal, Diretoria Executiva e Comitês de Risco e de Auditoria –, a áreas gestoras – Setor de Gestão de Riscos e Auditoria Interna – e corpo técnico. O objetivo foi promover maior autonomia no gerenciamento dos riscos e segregar funções entre os tomadores de riscos e os responsáveis pela sua identificação, promovendo um monitoramento sistemático que permeia toda estrutura de riscos, aumentando a barreira aos riscos associados à gestão financeira e atuarial dos planos de benefícios.

Os parâmetros e critérios que balizam os riscos inerentes ao aspecto financeiro – risco de mercado, riscos de crédito/concentração, risco de liquidez e risco atuarial – também passaram por ajustes, para deixá-los mais claros e aderentes à nova proposta de gestão dos investimentos, passando a contemplar, por exemplo, o monitoramento contínuo dos impactos das variações dos índices de preços das carteiras de investimentos, ampliando o controle na administração dos recursos dos planos administrados pela Petros. [Clique aqui para acessar o documento.](#)

Fonte: Petros, em 26.03.2021