*EAC0526 - Gestão de Riscos e Investimentos – Profa. Joanília Cia*

**Tema 01.2. Conceito de risco e gestão estratégica de riscos – Divulgação das informações de risco pelas empresas**

***HOME WORK 1***

***Responda as questões a seguir e envie através do Moodle/Stoa até às 11:10 do dia 28 de fevereiro (6ª.)***

**Com base na Nota explicativa 43 sobre Gestão de Riscos das Demonstrações Contábeis do BB 2012, responda as seguintes questões:**

1. O que é considerado e quais são os principais aspectos de risco de mercado?

Quis são os principais indicadores de risco de mercado controlados?

E como se controla a exposição ao risco de mercado?

Quais são os principais aspectos do VaR utilizado pelo BB?

Quais são os principais aspectos do teste de estresse utilizado pelo BB?

Como o banco controla a exposição cambial?

Que outras informações são divulgadas sobre risco de mercado?

1. O que é considerado e quais são os principais instrumentos de controle do risco de liquidez?

Que outras informações são divulgadas sobre risco de liquidez?

1. O que é considerado e quais são os principais instrumentos de controle do risco de crédito?

Como se mitiga o risco de crédito?

Como se mensura o risco de crédito?

Que outras informações são divulgadas sobre risco de crédito?

1. O que é considerado e quais são os principais instrumentos de controle e monitoramento do risco operacional?

Que outras informações são divulgadas sobre risco operacional?