

## **TERMO DE REFERÊNCIA**

### Contrato por Produto - Nacional

#### **1. Função no Projeto**

Especialista na área de Riscos

#### **2. Antecedentes**

O Governo brasileiro instituiu, por intermédio da Lei 11.887/08, o Fundo Soberano do Brasil (FSB) com a finalidade de apoiar projetos de interesse estratégico do País, ampliar a rentabilidade dos ativos financeiros mantidos pelo setor público, formar poupança pública, absorver flutuações dos ciclos econômicos e promover a internacionalização de empresas brasileiras.

De forma a pavimentar uma estrutura de gestão do fundo, o legislador previu a constituição de arcabouço que se ampara na oferta de modernas práticas de governança e de transparência, dentre as quais se destacam a constituição do Conselho Deliberativo, que fornecerá o rumo estratégico e tático de atuação do FSB, a contratação de instituição financeira federal responsável pela gestão compartilhada dos recursos do FSB, o encaminhamento periódico de relatórios ao Congresso Nacional prestando conta dos atos de gestão realizados e do desempenho das aplicações, entre outros aspectos.

É neste contexto que se insere a Secretaria do Tesouro Nacional, órgão incumbido legalmente pela gestão de todos os atos relacionados ao FSB. Tal contexto requer a constituição de inteligência, aproveitando-se das sinergias eventualmente existentes junto a outros departamentos da STN, para prover meios próprios voltados à gestão eficaz dos recursos públicos alocados no FSB.

#### **3. Órgão Envolvido**

O trabalho será supervisionado pela Coordenação-Geral de Gestão do Fundo Soberano do Brasil da Secretaria do Tesouro Nacional do Ministério da Fazenda – COFSB/STN/MF.

#### **4. Objetivos da Consultoria**

Contratação de Consultor Sênior em Riscos para prestar serviços para a COFSB/STN/MF na implantação de Sistemática para gestão do Fundo Soberano do Brasil e dos riscos a ele relacionados.

#### **5. Descrição das Atividades**

As atividades a serem desenvolvidas pelo consultor deverão abranger:

- ✓ Estruturação de instrumentos voltados ao gerenciamento dos riscos de mercado que envolvem os ativos do FSB, além de melhores práticas para monitoramento dos riscos de crédito e liquidez;
- ✓ Desenvolvimento de manuais contemplando as funcionalidades implementadas, as melhores práticas de governança, limites de alocação prudencial etc;
- ✓ Definição dos parâmetros para macro e micro alocação dos recursos do FSB;
- ✓ Recomendação de estrutura funcional para abarcar todas as funcionalidades desenvolvidas.

## **6. Produtos Esperados**

- 1) Plano de Trabalho Detalhado
- 2) Relatório contendo diagnóstico das áreas/sistemas de risco presentes na STN, bem como Modelo de acompanhamento do Risco de Mercado a que o Fundo Soberano do Brasil - FSB se sujeita
- 3) Desenvolvimento de arcabouço para monitoramento qualitativo do risco de crédito e liquidez do FSB, perfazendo o conjunto básico dos Riscos Financeiros envolvidos e consolidação em Manual de Riscos contemplando todos os modelos, regras prudenciais e de enquadramento aplicados ao Risco Financeiro do FSB
- 4) Estabelecimento das atribuições e responsabilidades do Conselho Deliberativo no âmbito do FSB, conforme diretrizes emanadas pelo art.2º, Inciso I do Decreto 7.055/09, bem como proposição de estrutura organizacional condizente às necessidades do FSB
- 5) Concepção de normativo que ampare e defina o processo de investimentos do Fundo FSB, abarcando limites p/ macro e micro alocação dos ativos, modalidades de gestão, benchmarks, etc, incluindo proposta de modelo-base de Política de Investimentos anual e plurianual do Fundo
- 6) Concepção de metodologia de auxílio à macro-alocação dos recursos do FSB, em consonância às diretrizes traçadas pela Lei 11.887/08 e Decreto 7.055/09 e definição e padronização dos mandatos de gestão dos veículos de investimento definidos para o FSB (4 perfis distintos)
- 7) Estruturação de arcabouço contendo as melhores práticas de governança corporativa a serem adotadas pela STN enquanto gestor do FSB

## **7. Qualificações Profissionais**

Profissional de Nível Superior com, pelo menos, 10 anos de experiência em modelos de *pricing*, que comprove, por meio de atestados de capacidade técnica, a coordenação/execução de 3 trabalhos de porte de implementação e acompanhamento de sistemática de risco.

## 8. Insumos

A COFSB/STN/MF disponibilizará as informações e dados necessários para subsidiar e auxiliar as tarefas e atividades previstas neste Termo de Referência. Eventuais despesas com diárias e passagens serão custeadas pela COFSB/STN/MF.

## 9. Nome do Supervisor

Lísicio Fábio de Brasil Camargo

## Cargo Do Supervisor

Diretor Nacional

## 10. Localidade do Trabalho

Brasília - DF

## 11. Data de Início

01/04/2010

## 12. Data de Término

31/12/2010

## 13. Produtos x Honorários

Descrição	Prazo (dias)
Plano de Trabalho Detalhado	7
Relatório contendo diagnóstico das áreas/sistemas de risco presentes na STN, bem como Modelo de acompanhamento do Risco de Mercado a que o Fundo Soberano do Brasil - FSB se sujeita	43
Desenvolvimento de arcabouço para monitoramento qualitativo do risco de crédito e liquidez do FSB, perfazendo o conjunto básico dos Riscos Financeiros envolvidos e consolidação em Manual de Riscos contemplando todos os modelos, regras prudenciais e de enquadramento aplicados ao Risco Financeiro do FSB	67
Estabelecimento das atribuições e responsabilidades do Conselho Deliberativo no âmbito do FSB, conforme diretrizes emanadas pelo art.2º, Inciso I do Decreto 7.055/09, bem como proposição de estrutura organizacional condizente às necessidades do FSB	99

Descrição	Prazo (dias)
Concepção de normativo que ampare e defina o processo de investimentos do Fundo FSB, abrangendo limites p/ macro e micro alocação dos ativos, modalidades de gestão, benchmarks, etc, incluindo proposta de modelo-base de Política de Investimentos anual e plurianual do Fundo	129
Concepção de metodologia de auxílio à macro-alocação dos recursos do FSB, em consonância às diretrizes traçadas pela Lei 11.887/08 e Decreto 7.055/09 e definição e padronização dos mandatos de gestão dos veículos de investimento definidos para o FSB (4 perfis distintos)	164
Estruturação de arcabouço contendo as melhores práticas de governança corporativa a serem adotadas pela STN enquanto gestor do FSB	204

Os pagamentos serão feitos após apresentação dos produtos atestados pela direção do projeto.

## Envio de currículos

Data limite para apresentação: 26/03/2010

Endereço para envio: [georf.codin.df.stn@fazenda.gov.br](mailto:georf.codin.df.stn@fazenda.gov.br)