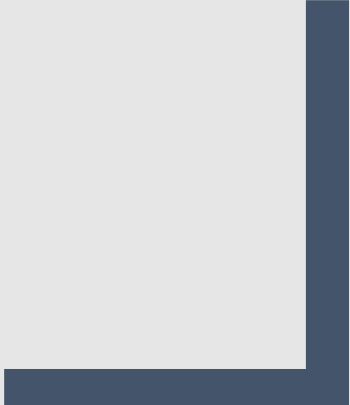


ESTRUTURA DE GESTÃO DO RISCO DE LIQUIDEZ



1. OBJETIVO

Esse documento tem como objetivo descrever a estrutura de Gestão de Risco de Liquidez da Dock, em atendimento à Circular 3.681, no que diz respeito a divulgação em relatório anual de acesso público, conforme artigo 6º.

2. DOCUMENTOS DE REFERÊNCIA

- Circular 3.681/13 – Banco Central do Brasil

3. ORGANOGRAMA



4. PAPÉIS E RESPONSABILIDADES

Comitê de Riscos

- Avaliar e aprovar anualmente as políticas, procedimentos e estratégias;
- Aprovar os limites de caixa mínimo do gerenciamento de risco de liquidez; e
- Aprovar anualmente o Plano de Contingência de Liquidez.

Gestão de Riscos

- Analisar e monitorar as informações disponibilizadas pela área de finanças e tesouraria;
- Definir processos para identificar, avaliar, monitorar e controlar a exposição ao risco de liquidez em diferentes horizontes de tempo, inclusive intradia;
- Definir e manter atualizado plano de contingência de liquidez que estabeleça responsabilidades e procedimentos para enfrentar situações de estresse de liquidez; e
- Elaborar periodicamente relatórios gerenciais relativos ao risco de liquidez, bem como relatório anual da estrutura de gerenciamento de risco de liquidez para divulgação pública.

Finanças/Tesouraria

- Realizar as conciliações diárias de caixa;
- Realizar as conciliações diárias das transações de contas de pagamento; e
- Reportar diariamente as posições financeiras com o controle de ativos e passivos, demonstrando os saldos de terceiros, investimentos e as principais movimentações em D-1 e D-2.

5. GESTÃO DO RISCO DE LIQUIDEZ

A gestão de Risco de Liquidez é realizada através de identificação, avaliação, monitoramento e controles para mitigar a exposição ao risco de liquidez em diferentes horizontes de tempo.

Com o objetivo de monitorar e analisar o risco de liquidez da Dock, alguns procedimentos são realizados, sendo eles: monitoramento de caixa mínimo, análise diária do fluxo de caixa e reporte diário das posições de caixa.

Todos os procedimentos relacionados à estrutura de Gestão de Risco de Liquidez são documentados em políticas e manuais internos.

6. VIGÊNCIA

Esse documento tem vigência de 12 meses a partir de sua publicação.