



## **Estrutura de Gerenciamento de Capital**

EXCLUSIVO PARA USO INTERNO

**Última atualização: 22/12/2011**

A reprodução e a distribuição deste manual fora do Modal sem a devida autorização é terminantemente proibida e constitui uma violação da política de controles internos.

**Produzido pela**  
Área de Compliance

**Aprovado e revisado pelo**  
Comitê de Risco de Crédito





A estrutura de gerenciamento de capital deverá abranger as atividades relativas aos gerenciamento dos riscos de mercado, liquidez, de crédito e operacional, bem como as pessoas envolvidas na elaboração e formalização dos planos estratégicos.

Para melhor atendimento a esta política fica estabelecido que a Estrutura de Gerenciamento de Capital é composta como segue:

Comitê de Gestão de Capital – Este comitê é formado pelo Executivo de Risco, dois componentes do Conselho de Administração, Economista-Chefe e pelo menos um Executivo envolvido na elaboração do Planejamento Estratégico.

Comitê de Estratégia – Este comitê é formado por 4 Executivos da Diretoria Executiva, os quais deverão elaborar e formalizar o plano estratégico para o triênio seguinte. Este Comitê é responsável ainda pelo acompanhamento dos indicadores de atingimento da estratégica traçada para o ano vigente e deverá se reunir no mínimo a cada semestre.

Comitê de Riscos – Comitê formado pelos Executivos envolvidos com o Gerenciamento dos Riscos de Mercado, Liquidez, Crédito, Operacional e Contabilidade e pelo Gerente de área. Este Comitê deverá se reunir, no mínimo, semestralmente.

Gerência de Risco de Mercado, Liquidez e Crédito – Gerência responsável pelo monitoramento e controle dos Riscos relativos às posições financeiras mantidas pela instituição.

Gerência de Risco Operacional – Gerência responsável pelo monitoramento e controle dos riscos operacionais ocorridos na instituição.

Gerência de Controladoria – Gerência responsável pelo acompanhamento e cálculos do Patrimônio de Referência Exigido (PRE) e parcelas de riscos a serem consideradas na alocação de capital.