



Ministério da Fazenda



Av. Presidente Vargas, 800 - Belém (PA) - Companhia Aberta - Carta Patente: 3.369/00001 - CNPJ: 04.902.979/0001-44

a.2) Quanto aos ajustes

	30.06.2015			31.12.2014			30.06.2014		
	Custo	Mercado	Marcação	Custo	Mercado	Marcação	Custo	Mercado	Marcação
Para negociação	731.659	731.522	(137)	1.695.902	1.690.421	(5.481)	654.106	654.129	23
Letras Fin. do Tesouro	731.659	731.522	(137)	690.698	690.554	(144)	654.106	654.129	23
Letras do Tesouro Nacional	-	-	-	1.005.204	999.867	(5.337)	-	-	-
Disponíveis para venda	5.058.997	5.053.300	(5.697)	4.848.851	4.845.814	(3.036)	4.820.759	4.819.461	(1.298)
Letras Fin. do Tesouro	3.220.042	3.218.449	(1.593)	3.126.506	-	(1.694)	3.073.492	3.072.698	(794)
Letras do Tesouro Nacional	32.788	32.676	(112)	-	-	-	-	-	-
Notas do Tesouro Nacional	51.362	50.153	(1.209)	-	-	-	162.185	162.111	(74)
Debêntures	739.147	737.051	(2.096)	695.175	694.510	(665)	684.357	684.965	608
Cotas Fundos Invest.-FIDC	64.354	63.668	(686)	63.037	62.351	(686)	55.778	54.740	(1.038)
Cotas Fundos Invest.-FI REF	103.236	103.236	-	91.878	91.878	-	76.303	76.303	-
Outros Títulos Privados - LF	848.068	848.067	(1)	872.255	872.264	9	768.644	768.644	-
Mantidos até o vencimento	304.093	304.093	-	308.668	308.668	-	341.812	341.812	-
Notas do Tesouro Nacional	10.264	10.264	-	10.267	10.267	-	9.970	9.970	-
Certificado Depósito Bancário	-	-	-	-	-	-	20.810	20.810	-
Certificados Fin. do Tesouro	293.741	293.741	-	298.315	298.315	-	310.858	310.858	-
Outros títulos públicos - TDA	88	88	-	86	86	-	174	174	-

Do total aplicado em Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), há o montante de R\$1.150 aplicado no fundo administrado pelo Banco BVA (R\$1.225 em 31.12.2014 e R\$1.275 em 30.06.2014), para o qual foi constituída uma provisão sobre 50% do valor do custo do título na época da aquisição no montante de R\$686 (R\$686 em 31.12.2014 e R\$1.038 em 30.06.2014) para eventual perda que possa ocorrer devido a intervenção do Banco Central no administrador do Fundo, apesar de não existirem atrasos nos vencimentos dos juros.

Para fins contábeis, os títulos mantidos até o vencimento estão registrados à curva. Caso fossem marcados a mercado, teriam um ajuste negativo de R\$44.004 (R\$43.059 em 31.12.2014 e R\$37.042 em 30.06.2014).

Do total das CFT's, o montante de R\$281.620 (R\$286.006 em 31.12.2014 e R\$298.031 em 30.06.2014) foi recebido pelo Banco no Programa de Fortalecimento das Instituições Financeiras Federais instituído pela Medida Provisória nº 2.196, de 27 de junho de 2001, que contemplou a permuta por títulos dos créditos existentes junto à União dos financiamentos celebrados ao amparo da Lei nº 8.727, de 05 de novembro de 1993. Caso estivessem marcadas a mercado apresentariam uma desvalorização de R\$41.671 (R\$40.657 em 31.12.2014 e R\$34.822 em 30.06.2014).

No 1º semestre de 2015, não houve reclassificações entre categorias nos títulos e valores mobiliários.

O resultado com TVM totalizou no semestre R\$429.581 (R\$355.279 no 1º sem/2014).

b) Instrumentos Financeiros Derivativos

O Banco da Amazônia se utiliza de instrumentos financeiros derivativos para gerenciar suas posições e atender às necessidades, de acordo com limites e alçadas estabelecidas em seus normativos, possuindo ferramentas e sistemas adequados ao gerenciamento desses instrumentos, utilizando metodologias estatísticas e simulação para mensurar os riscos de suas posições, utilizando modelos de valor em risco, de sensibilidade e análise de estresse.

O principal risco inerente a esses instrumentos derivativos é o risco de mercado que é a possibilidade de perdas causadas por mudanças no comportamento das taxas de juros e de câmbio, nos preços de ações e de commodities.

Instrumentos Financeiros Derivativos classificados como *hedge* de Risco de Mercado

Ajuste a Valor de Mercado			
Instrumento de Hedge	30.06.2015	31.12.2014	30.06.2014
Futuro de Juros (Vcto jan/2019)	33.429	275.756	-
Total	33.429	275.756	-

Margem dada em garantia de operações com Instrumentos Financeiros Derivativos

Especificação	30.06.2015	31.12.2014	30.06.2014
Letras Financeiras do Tesouro	2.770	64.120	-
Total	2.770	64.120	-

Resultado com Instrumentos Financeiros Derivativos

Especificação	30.06.2015	31.12.2014	30.06.2014
Ajustes Financeiros Acumulados	(7.792)	(208)	-
Total	(7.792)	(208)	-

7 Carteira de Crédito

As operações de crédito e outros créditos, classificadas de acordo com a Resolução nº 2.682/1999, do CMN, estão compostas da seguinte forma:

	30.06.2015			31.12.2014			30.06.2014		
	Normais	Vencidas	Total	Normais	Vencidas	Total	Normais	Vencidas	Total
Operações de crédito									
Empréstimos	1.304.104	105.704	1.409.808	1.105.578	56.475	1.162.053	951.093	53.065	1.004.158
Títulos descontados	44.961	4.575	49.536	39.070	3.301	42.371	22.382	3.182	25.564
Financiamentos	1.348.849	18.309	1.367.158	1.181.785	12.435	1.194.220	1.134.768	14.741	1.149.509
Financiamentos rurais	871.236	42.774	914.010	792.619	9.231	801.850	505.844	6.847	512.691
Subtotal	3.569.150	171.362	3.740.512	3.119.052	81.442	3.200.494	2.614.087	77.835	2.691.922
Outros créditos									
Diversos	921	7	928	1.352	15	1.367	1.774	26	1.800
Subtotal	3.570.071	171.369	3.741.440	3.120.404	81.457	3.201.861	2.615.861	77.861	2.693.722
Adiantamento sobre contrato de câmbio	21.071	-	21.071	24.136	4.765	28.901	17.173	7.071	24.244
TOTAL DA CARTEIRA	3.591.142	171.369	3.762.511	3.144.540	86.222	3.230.762	2.633.034	84.932	2.717.966
(Provisões)									
(Operações de crédito)	(75.673)	(56.598)	(132.271)	(41.943)	(36.973)	(78.916)	(39.365)	(38.551)	(77.916)
(Outros créditos)	(5)	(4)	(9)	(6)	-	(6)	-	(10)	(10)
(Câmbio)	(133)	-	(133)	(143)	(4.765)	(4.908)	(98)	(3.048)	(3.146)
TOTAL DAS PROVISÕES	(75.811)	(56.602)	(132.413)	(42.092)	(41.738)	(83.830)	(39.463)	(41.609)	(81.072)
TOTAL LÍQUIDO	3.515.331	114.767	3.630.098	3.102.448	44.484	3.146.932	2.593.571	43.323	2.636.894