



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

Ministério da Fazenda



	30.06.2016						TOTAL
	Até 3 meses	3 a 12 meses	1 a 3 anos	3 a 5 anos	5 a 15 anos	Acima 15 anos	
1-Títulos para negociação⁽¹⁾	-	55.316	779.406	-	-	-	834.722
Títulos Públicos	-	55.316	779.406	-	-	-	834.722
Letras Financeiras do Tesouro	-	55.316	779.406	-	-	-	834.722
2-Títulos Disponíveis para venda	208.625	531.094	1.863.648	1.610.509	739.792	-	4.953.668
Títulos Públicos	-	131.968	1.183.707	1.470.684	739.792	-	3.526.151
Letras Financeiras do Tesouro	-	131.968	1.146.349	1.470.684	739.792	-	3.488.793
Letras do Tesouro Nacional	-	-	37.358	-	-	-	37.358
Títulos Privados	208.625	399.126	679.941	139.825	-	-	1.427.517
Debêntures	77.927	84.064	347.469	97.770	-	-	607.230
Cotas Fundos de Invest.-FIDC ⁽²⁾	36.501	20.034	11.058	-	-	-	67.593
Cotas Fundos de Invest.-FI REF	68.731	-	-	-	-	-	68.731
Outros Títulos - LF/NP	25.466	295.028	321.414	42.055	-	-	683.963
3-Títulos Mantidos até o vencimento	-	-	314	249.344	289.324	239.908	778.890
Títulos Públicos	-	-	314	249.344	289.324	239.908	778.890
Notas do Tesouro Nacional	-	-	314	249.344	770	239.908	490.336
Certificados Financeiros do Tesouro	-	-	-	-	288.554	-	288.554
Total 30.06.2016	208.625	586.410	2.643.368	1.859.853	1.029.116	239.908	6.567.280
Total 31.12.2015	465.640	225.194	2.683.404	1.778.120	687.247	211.940	6.051.545
Total 30.06.2015	398.292	400.460	2.039.003	2.318.121	933.039	-	6.088.915

(1) Para fins de publicação, os títulos denominados para negociação são apresentados apenas no ativo circulante, conforme § único do art. 7º da Circular nº 3.068/2001.
(2) Valor líquido de provisão.

a.2) Quanto aos ajustes

	30.06.2016			31.12.2015			30.06.2015		
	Custo	Mercado	Marcação	Custo	Mercado	Marcação	Custo	Mercado	Marcação
Para negociação	834.785	834.722	(63)	782.194	782.126	(68)	731.659	731.522	(137)
Letras Financeiras do Tesouro	834.785	834.722	(63)	782.194	782.126	(68)	731.659	731.522	(137)
Disponíveis para venda	4.958.653	4.953.668	(4.985)	4.595.973	4.586.277	(9.696)	5.058.997	5.053.300	(5.697)
Letras Financeiras do Tesouro	3.491.082	3.488.793	(2.289)	2.936.494	2.935.713	(781)	3.220.042	3.218.449	(1.593)
Letras do Tesouro Nacional	37.009	37.358	349	34.868	31.594	(3.274)	32.788	32.676	(112)
Notas do Tesouro Nacional	-	-	-	55.925	52.986	(2.939)	51.362	50.153	(1.209)
Debêntures	609.024	607.230	(1.794)	666.839	664.945	(1.894)	739.147	737.051	(2.096)
Cotas Fundos Invest.-FIDC	68.279	67.593	(686)	66.030	65.344	(686)	64.354	63.668	(686)
Cotas Fundos Invest.-FI REF	69.296	68.731	(565)	75.954	75.832	(122)	103.236	103.236	-
Outros Títulos Privados - LF	683.963	683.963	-	759.863	759.863	-	848.068	848.067	(1)
Mantidos até o vencimento	778.890	778.890	-	683.142	683.142	-	304.093	304.093	-
Notas do Tesouro Nacional	490.336	490.336	-	391.024	391.024	-	10.264	10.264	-
Certificados Fin. do Tesouro	288.554	288.554	-	292.118	292.118	-	293.741	293.741	-
Outros Títulos Públicos - TDA	-	-	-	-	-	-	88	88	-

Do total aplicado em Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), há o montante de R\$1.549 aplicado no fundo administrado pelo Banco BVA (R\$1.642 em 31.12.2015 e R\$1.150 em 30.06.2015), 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 31.12.2015 e 30.06.2015) 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\$47.462 (R\$93.632 em 31.12.2015 e R\$44.004 em 30.06.2015).
Do total das CFT's, o montante de R\$276.648 (R\$280.064 em 31.12.2015 e R\$281.620 em 30.06.2015) 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\$40.360 (R\$41.837 em 31.12.2015 e R\$41.671 em 30.06.2015).

No 1º semestre de 2016, não houve reclassificações entre categorias nos títulos e valores mobiliários. O resultado com TVM totalizou no semestre R\$485.432 (R\$429.581 no 1º sem/2015).

a.3) Marcação a mercado (títulos disponíveis para venda)

Os ganhos e perdas não realizados no período relativos a títulos e valores mobiliários classificados na categoria disponíveis para venda, estão abaixo apresentados:

Marcação a mercado			
Especificação	30.06.2016	31.12.2015	30.06.2015
Desvalorização	(182.763)	(179.870)	(175.403)
Valorização	178.464	171.925	170.390
Total	(4.299)	(7.945)	(5.013)

Venda de Títulos Mantidos até o vencimento

Em fevereiro de 2013, o Banco assinou com a Caixa de Previdência Complementar do Banco da Amazônia (Capaf), 04 (quatro) contratos referentes ao saldamento dos planos de Benefício Definido (BD) e Misto, que importaram, naquela ocasião, em R\$685.327.
Em razão dessa obrigação, no período de 16/12/2015 a 07/01/2016, o Banco adquiriu títulos do Tesouro Nacional, com as seguintes características:

Título	Vencimento	Qde.	Taxa Média	Financeiro (R\$ milhões)
NTN-B Ago/2024	15/08/2024	82.700	IPCA + 7,33% ano	215,0
NTN-B Mai/2035	15/05/2035	93.710	IPCA + 7,37% ano	225,4
Total		176.410		440,4

A aquisição teve como pressuposto o seguinte:

- a) busca de títulos com vencimentos mais próximos possíveis dos vencimentos dos contratos;
- b) montantes que equalizassem o total dos contratos, juntamente com os CFT-E5 já existentes na carteira do Banco; e