



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

Ministério da Fazenda



(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

	30.06.2017			30.06.2016		
	Custo	Mercado	Marcação	Custo	Mercado	Marcação
Para negociação	542.495	542.822	327	834.785	834.722	(63)
Letras Financeiras do Tesouro	542.495	542.822	327	834.785	834.722	(63)
Disponíveis para venda	7.320.716	7.327.204	6.488	4.957.967	4.953.668	(4.299)
Letras Financeiras do Tesouro	5.905.772	5.908.542	2.770	3.491.082	3.488.793	(2.289)
Letras do Tesouro Nacional	83.871	87.029	3.158	37.009	37.358	349
Debêntures	349.130	350.255	1.125	609.024	607.230	(1.794)
Cotas Fundos Invest.-FIDC	9.935	9.935	-	67.593	67.593	-
Cotas Fundos de Invest.-Renda Fixa	41.326	41.326	-	-	-	-
Cotas Fundos Invest.-FI REF	56.574	56.009	(565)	69.296	68.731	(565)
Outros Títulos Privados - LF	874.108	874.108	-	683.963	683.963	-
Mantidos até o vencimento	752.019	-	-	778.890	-	-
Notas do Tesouro Nacional	508.871	-	-	490.336	-	-
Certificados Fin. do Tesouro	243.148	-	-	288.554	-	-

Do total aplicado em Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), há o montante de R\$470 aplicado no fundo administrado pelo Banco BVA (R\$1.549 em 30.06.2016), 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 30.06.2016) 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\$8.487 (ajuste negativo de R\$47.462 em 30.06.2016).

Do total das CFT's, o montante de R\$233.114 (R\$276.648 em 30.06.2016) foi recebido pelo Banco no Programa de Fortalecimento das Instituições Financeiras Federais instituído pela Medida Provisória nº 2.196, de 28 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\$25.830 (desvalorização de R\$40.360 em 30.06.2016).

No período, não houve reclassificação entre categorias nos títulos e valores mobiliários.

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:

	30.06.2017	30.06.2016
Desvalorização	(186.525)	(182.763)
Valorização	193.013	178.464
Total	6.488	(4.299)

a.4) Resultado de Operações com Títulos e Valores Mobiliários

	1º sem/2017	1º sem/2016
Aplicações Interfinanceiras de Liquidez	85.701	40.350
Títulos de Renda Fixa	418.419	423.523
Aplicação Fundos de Investimentos	2.264	-
Lucros com Títulos de Renda Fixa	540	21.968
Prejuízo com Títulos de Renda Fixa	(148)	(414)
Ajuste ao Valor de Mercado	641	5
Total	507.417	485.432

b) Instrumentos financeiros derivativos

O Banco da Amazônia se utiliza de instrumentos financeiros derivativos para gerenciar suas posições e atender as suas necessidades, de acordo com limites e alçadas estabelecidas em seus normativos, possuindo ferramentas e sistemas adequados ao gerenciamento desses instrumentos, utilizando-se de metodologias estatísticas e simulações 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 dos ativos e/ou passivos.

Ativos vinculados aos Instrumentos Financeiros Derivativos para hedge de Risco de Mercado

	Valor Justo	
	30.06.2017	30.06.2016
Ativos vinculados ao Hedge		
Letras do Tesouro Nacional (Vcto 2019)	87.029	37.358
Total	87.029	37.358

Instrumentos Financeiros Derivativos classificados como hedge de Risco de Mercado

	Valor Justo	
	30.06.2017	30.06.2016
Instrumento de Hedge		
Futuro de Juros (Contrato DI1F19 - Vcto Jan/2019)	87.029	37.373
Total	87.029	37.373

Margem dada em garantia de operações com Instrumentos Financeiros Derivativos

	30.06.2017	30.06.2016
Letras Financeiras do Tesouro (Vcto Mar/2019-2020)	7.135	3.162
Total	7.135	3.162

Resultado com Instrumentos Financeiros Derivativos

	1º sem/2017	1º sem/2016
Ajustes Financeiros Acumulados	(1.754)	(3.555)
Total	(1.754)	(3.555)

7. Operações de crédito

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

	30.06.2017			30.06.2016		
	A vencer	Vencidas	Total	A vencer	Vencidas	Total
Operações de crédito						
Empréstimos	1.006.942	104.517	1.111.459	1.248.593	114.325	1.362.918
Direitos creditórios descontados	26.769	4.618	31.387	21.763	11.969	33.732
Financiamentos	978.811	159.707	1.138.518	1.352.456	51.219	1.403.675
Financiamentos rurais	918.688	109.003	1.027.691	968.165	24.089	992.254
Subtotal	2.931.210	377.845	3.309.055	3.590.977	201.602	3.792.579
Outros créditos	191	-	191	384	-	384
Diversos	191	-	191	384	-	384
Subtotal	2.931.401	377.845	3.309.246	3.591.361	201.602	3.792.963
Adiant. s/ contrato de câmbio	55.427	-	55.427	40.571	758	41.329
Total da carteira (Provisões)	2.986.828	377.845	3.364.673	3.631.932	202.360	3.834.292
(Operações de crédito)	(96.106)	(195.971)	(292.077)	(69.592)	(83.510)	(153.102)
(Outros créditos)	(2)	-	(2)	(4)	-	(4)
(Câmbio)	(465)	-	(465)	(204)	(23)	(227)
Total das provisões	(96.573)	(195.971)	(292.544)	(69.800)	(83.533)	(153.333)
Total líquido	2.890.255	181.874	3.072.129	3.562.132	118.827	3.680.959

a) Quanto aos setores de atividade econômica, a carteira está assim apresentada:

	30.06.2017	30.06.2016
Setor Público	380.784	401.360
Administração direta	40.013	57.717
Administração indireta	131.355	132.212
Atividades empresariais	209.416	211.431
Setor Privado	2.983.889	3.432.932
Rural	1.027.780	992.928
Indústria	888.342	916.889
Comércio	583.233	758.170
Pessoas físicas	237.041	262.956
Serviços	247.447	501.989
Intermediários financeiros	46	-
Total da carteira	3.364.673	3.834.292

b) Concentração dos principais devedores:

	30.06.2017	% Carteira	30.06.2016	% Carteira
10 maiores devedores	1.268.825	37,7	1.534.607	40,0
50 maiores devedores	755.177	22,4	906.762	23,6
100 maiores devedores	282.041	8,4	301.245	7,9
Demais devedores	1.058.630	31,5	1.091.678	28,5
Total	3.364.673	100,0	3.834.292	100,0

Estes créditos apresentam o perfil especificado a seguir e são classificados de acordo com o critério de vencimento de parcelas, os valores de outros créditos não são considerados no quadro: