



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

Ministério da Fazenda



A Provisão para perdas em aplicações em depósitos interfinanceiros, no valor de R\$32.274 (R\$32.274 em 31.12.2016), corresponde ao total aplicado junto ao extinto Banco Santos. A provisão foi constituída pelo valor integral em face da intervenção e liquidação.

As receitas com aplicações interfinanceiras de liquidez totalizaram, no exercício, R\$164.569 (R\$96.648 em 2016) e estão registradas como rendas de TVM.

6 Títulos e valores mobiliários e instrumentos financeiros derivativos

a) Títulos e valores mobiliários

A carteira de títulos e valores mobiliários está distribuída da seguinte forma:

	31.12.2017	31.12.2016
Carteira própria – livres	9.410.839	6.797.016
Títulos Públicos	7.962.672	5.551.830
Letras Financeiras do Tesouro	6.921.147	4.738.801
Letras do Tesouro Nacional	92.746	40.614
Notas do Tesouro Nacional	724.960	502.100
Certificados Financeiros do Tesouro	223.819	270.315
Títulos Privados	1.448.167	1.245.186
Debêntures	398.038	452.452
Cotas de Fundos de Investimento-FIDC	40.197	9.932
Cotas de Fundos de Investimento-Renda Fixa	43.065	39.061
Cotas de Fundos de Investimento-FI REF	1.366	53.232
Letras Financeiras	965.501	690.509
Vinculados a operações compromissadas	105.360	220.109
Títulos Públicos	105.360	220.109
Letras Financeiras do Tesouro	105.360	220.109
Vinculados a prestação de garantias	29.000	25.232
Títulos Públicos	29.000	25.232
Letras Financeiras do Tesouro	29.000	25.232
Total	9.545.199	7.042.357
Circulante	519.520	1.042.155
Não circulante	9.025.679	6.000.202

A composição da Carteira de TVM é resultante da política financeira adotada pelo Banco por meio de seu Comitê de Ativos e Passivos. A maior contribuição está representada pelos títulos públicos correspondendo a 84,8% do total da Carteira (82,3% em 31.12.2016).

Dos títulos relacionados a prestação de garantias, R\$26.902 (R\$21.342 em 31.12.2016) estão vinculados às câmaras de compensação, B3 – Brasil Bolsa Balcão e Câmara Interbancária de Pagamentos (CIP), e R\$2.098 (R\$3.890 em 31.12.2016) em garantia de processos judiciais.

Classificação dos títulos e valores mobiliários

a.1) Quanto ao vencimento

	31.12.2017						
	Até 3 meses	3 a 12 meses	1 a 3 anos	3 a 5 anos	5 a 15 anos	Acima 15 anos	TOTAL
1-Títulos para negociação⁽¹⁾	-	-	-	194.522	104.618	-	299.140
Títulos Públicos	-	-	-	194.522	104.618	-	299.140
Letras Financeiras do Tesouro	-	-	-	194.522	104.618	-	299.140
2-Títulos Disponíveis p/ venda	87.450	132.581	2.978.231	3.269.448	1.785.139	254.601	8.507.450
Títulos Públicos	2.386	17.388	1.965.226	3.127.379	1.736.734	210.170	7.059.283
Letras Financeiras do Tesouro	2.386	17.388	1.872.480	3.127.379	1.736.734	-	6.756.367
Letras do Tesouro Nacional	-	-	92.746	-	-	-	92.746
Notas do Tesouro Nacional	-	-	-	-	-	210.170	210.170
Títulos Privados	85.064	115.193	1.013.005	142.069	48.405	44.431	1.448.167
Debêntures	23.514	89.015	126.024	131.398	28.087	-	398.038
Cotas Fundos Invest.– FIDC ⁽²⁾	-	-	40.197	-	-	-	40.197
Cotas Fundos Invest.–R. Fixa	-	-	-	-	-	43.065	43.065
Cotas Fundos Invest.–FI REF	-	-	-	-	-	1.366	1.366
Outros Títulos – LF/NP	61.550	26.178	846.784	10.671	20.318	-	965.501
3-Títulos Mantidos até o vencimento	349	-	11	223.822	257.149	257.278	738.609
Títulos Públicos	349	-	11	223.822	257.149	257.278	738.609
Notas do Tesouro Nacional	349	-	11	3	257.149	257.278	514.790
Certificados Fin. do Tesouro	-	-	-	223.819	-	-	223.819
Total 31.12.2017	87.799	132.581	2.978.242	3.687.792	2.146.906	511.879	9.545.199
Total 31.12.2016	192.324	673.519	1.242.444	2.111.695	2.482.762	339.613	7.042.357

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

(2) Valor líquido de provisão (nota nº 6.a.2).

a.2) Quanto aos ajustes

	31.12.2017			31.12.2016		
	Custo	Mercado	Marcação	Custo	Mercado	Marcação
Para negociação	298.672	299.140	468	561.533	561.218	(315)
Letras Financeiras do Tesouro	298.672	299.140	468	561.533	561.218	(315)
Disponíveis para venda	8.467.105	8.489.639	22.534	5.714.017	5.708.724	(5.293)
Letras Financeiras do Tesouro	6.751.036	6.756.367	5.330	4.429.242	4.422.924	(6.318)
Letras do Tesouro Nacional	88.575	92.746	4.172	39.339	40.614	1.275
Notas do Tesouro Nacional	179.449	192.003	12.554	-	-	-
Debêntures	397.560	398.038	478	452.137	452.452	315
Cotas Fundos Invest.– FIDC	40.553	40.553	-	9.932	9.932	-
Cotas Fundos de Invest.– Renda Fixa	43.065	43.065	-	39.061	39.061	-
Cotas Fundos Invest.– FI REF	1.366	1.366	-	53.797	53.232	(565)
Outros Títulos Privados – LF	965.501	965.501	-	690.509	690.509	-
Mantidos até o vencimento	728.810	-	-	772.415	-	-
Notas do Tesouro Nacional	504.991	-	-	502.100	-	-
Certificados Fin. do Tesouro	223.819	-	-	270.315	-	-

Do total aplicado em Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), há o montante de R\$443 aplicado no fundo administrado pelo Banco BVA (R\$434 em 31.12.2016), para o qual foi constituída uma provisão sobre 50% do valor do custo do título na época da aquisição no montante de R\$357 (R\$686 em 31.12.2016) 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 positivo de R\$94.848 (ajuste negativo de R\$34.804 em 31.12.2016).

Do total das CFTs, o montante de R\$214.584 (R\$259.161 em 31.12.2016) 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 valorização de R\$57.708 (desvalorização de R\$37.602 em 31.12.2016).

Caso as NTNs estivessem marcadas a mercado apresentariam uma valorização de R\$34.656 (valorização de R\$11.719 em 31.12.2016).

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:

	31.12.2017	31.12.2016
Desvalorização	(187.726)	(185.781)
Valorização	210.260	180.488
Total	22.534	(5.293)

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

	2º Semestre/2017	Exercício/2017	Exercício/2016
Aplicações Interfinanceiras de Liquidez	78.868	164.569	96.648
Títulos de Renda Fixa	370.062	788.481	877.266
Aplicação Fundos de Investimentos	1.751	4.015	3.993
Lucros com Títulos de Renda Fixa	416	955	58.570
Desvalorização de Títulos Livres	329	329	-
Prejuízo com Títulos de Renda Fixa	(43)	(191)	(557)
Ajuste ao Valor de Mercado	142	783	(247)
Total	451.525	958.941	1.035.673

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.