



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

A provisão para perdas em aplicações em depósitos interfinanceiros, no valor de R\$ 8.023 (R\$ 17.459 em 31/12/2022), corresponde ao total aplicado junto ao extinto Banco Santos. A provisão foi constituída pelo valor integral em face da intervenção e da liquidação. As Aplicações Interfinanceiras de Liquidez cresceram em função do aumento do volume das Operações Compromissadas e dos Depósitos Financeiros vinculados ao Crédito Rural.

6. Títulos e Valores Mobiliários (TVM)

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

	31.12.2023	31.12.2022
Carteira Própria – Livres	15.534.356	10.913.720
Títulos Públicos	13.386.348	8.389.137
Letras Financeiras do Tesouro	12.663.769	7.983.114
Notas do Tesouro Nacional	95.181	-
Certificados Financeiros do Tesouro	627.398	406.023
Títulos Privados	2.148.008	2.524.583
Debêntures	520.122	734.695
Cotas de Fundos de Investimento - FIDC	40.134	39.495
Cotas de Fundos de Investimento - Renda Fixa	51.825	46.452
Cotas de Fundos de Investimento - FI REF	900	794
Letras Financeiras	1.535.027	1.684.242
Título de Renda Variável - Ações	-	18.646
Cotas de Renda Variável - FINAM	-	259
Vinculados a Operações Compromissadas	-	70.080
Títulos Públicos	-	70.080
Letras Financeiras do Tesouro	-	70.080
Vinculados a Prestação de Garantias	565.411	624.995
Títulos Públicos	565.411	624.995
Letras Financeiras do Tesouro	54.348	48.018
Notas do Tesouro Nacional	511.063	576.977
Total	16.099.767	11.608.795
Circulante	2.842.528	3.450.080
Não Circulante	13.257.239	8.158.715

A composição da carteira de TVM é resultante das políticas financeiras e adotadas pelo Banco (Declaração de apetite a riscos, Gestão de Capital dentre outras) e da supervisão e monitoramento do Comitê de Ativos e Passivos e do Comitê Estratégico de Crédito, Riscos e Capital. A maior contribuição está representada pelos títulos públicos correspondendo a 86,7% do total da carteira (78,3% em 31/12/2022). Dos títulos relacionados à prestação de garantias, R\$ 54.348 (R\$ 48.018 em 31/12/2022) estão vinculados às câmaras de compensação, B³ - Brasil, Bolsa, Balcão e Nuclea, e R\$ 511.063 (R\$ 576.977 em 31/12/2022) em garantias com operações BB Previdência. A elevação da carteira de TVM, principalmente em LFTs, foi motivada pelo maior ingresso de recursos por meio do FNO e dos depósitos especiais/investimentos.

Classificação dos títulos e valores mobiliários

a.1) Por vencimento

	Sem vencimento	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⁾	-	-	-	-	56.681	-	-	56.681
Títulos Públicos	-	-	-	-	56.681	-	-	56.681
Letras Financeiras do Tesouro	-	-	-	-	56.681	-	-	56.681
2-Títulos Disponíveis p/ Venda	52.725	1.333.194	1.399.329	3.046.543	3.772.277	6.130.703	307.065	16.041.836
Títulos Públicos	-	1.070.676	349.023	2.412.749	3.623.612	6.130.703	307.065	13.893.828
Letras Financeiras do Tesouro	-	1.070.676	253.842	2.412.749	3.579.551	5.344.618	-	12.661.436
Letras do Tesouro Nacional	-	-	95.181	-	-	-	-	95.181
Notas do Tesouro Nacional	-	-	-	-	44.061	786.085	307.065	1.137.211
Títulos Privados	52.725	262.518	1.050.306	633.794	148.665	-	-	2.148.008
Debêntures	-	1.472	224.106	203.306	91.238	-	-	520.122