



BANCO DO ESTADO DO PARÁ S.A. - COMPANHIA ABERTA • CNPJ 04.913.711/0001-08 • NIRE 1530000114  
Avenida Presidente Vargas, nº 251, Centro – CEP 66.010-000 – Belém-Pará



Movimentação das provisões:

	30.06.2017			30.06.2016		
	Trabalhista	Cível	Fiscais e Previdenciárias	Trabalhista	Cível	Fiscais e Previdenciárias
<b>No início do Semestre</b>	<b>35.278</b>	<b>10.365</b>	<b>2.961</b>	<b>15.278</b>	<b>11.387</b>	<b>3.023</b>
Atualização monetária	3.352	462	179	1.093	965	230
Constituições	18.063	414	-	10.486	11	-
Reversões	(5.583)	(1.739)	-	(1.700)	(20)	(451)
Pagamentos	(596)	-	-	(18)	(2.195)	-
<b>No final do Semestre</b>	<b>50.514</b>	<b>9.501</b>	<b>3.140</b>	<b>25.139</b>	<b>10.148</b>	<b>2.802</b>

### 13. PATRIMÔNIO LÍQUIDO

#### 13.1. Capital Social

O Capital Social, subscrito e integralizado, está representado 9.521.649 ações ordinárias nominativas, escriturais, sem valor nominal, todas de domiciliados no País e com direito a voto. O quadro abaixo indica a quantidade de ações detidas pelos acionistas do Banco:

O quadro abaixo indica a quantidade de ações detidas pelos acionistas do Banco.

Acionista	30.06.2017		30.06.2016	
	Quantidade	%	Quantidade	%
Estado do Pará	9.519.433	99,97673	9.519.433	99,97673
Caixa de Previdência e Assistência aos funcionários do Banpará	755	0,00793	755	0,00793
Administradores	9	0,00009	9	0,00009
Demais Acionistas	1.452	0,01525	1.452	0,0153
<b>Total</b>	<b>9.521.649</b>	<b>100,00</b>	<b>9.521.649</b>	<b>100,00</b>

#### Ações em circulação

O quadro abaixo indica a quantidade de ações emitidas pelo BANPARÁ, em circulação.

Espécie e Classe de Ações	Ações não circulação <sup>1</sup>	Ações em circulação <sup>2</sup>	Total de Ações	% Ações em circulação
ON	9.519.442	2.207	9.521.649	0,02318

<sup>1</sup> Compreende ações de titularidade do Estado do Pará e dos Administradores do BANPARÁ.

<sup>2</sup> Totais de ações emitidas pelo BANPARÁ, excetuadas aquelas identificadas na opção 1, acima.

#### 13.2. Dividendos/Juros sobre capital próprio

O Banco adota uma política de remuneração do capital distribuindo juros sobre o capital próprio no valor máximo calculado em conformidade com a legislação vigente, os quais são imputados, líquidos de Imposto de Renda na Fonte, no cálculo dos dividendos obrigatórios do exercício previsto no Estatuto Social e artigo 202 da Lei nº 6.404/76. Por conseguinte, em conformidade com o capítulo VII do Estatuto Social e Política de distribuição de dividendos, o Banco distribui dividendos obrigatórios ao final do exercício, podendo no intervalo, distribuir dividendos intermediários e ou intercalares.

Até o final do 1º semestre de 2017, foi efetivamente pago a título de Juros sobre Capital Próprio o valor de R\$ 15.154. O valor, referente ao primeiro trimestre de 2017, aprovado pelo conselho de administração em 10.04.2017 e efetivamente pago em 20.04.2017.

### 14. GESTÃO DE RISCO

#### Gestão de Risco e de Capital

No que diz respeito à gestão de riscos e de Capital, o Banco desenvolve suas atividades de acordo com recomendações do Comitê de Basileia, alinhada às boas práticas de mercado, utilizando como processos contínuos o aprimoramento das políticas e dos sistemas informatizados todos integrados aos objetivos estratégicos do Banco. São acompanhados, mensurados e mitigados os seguintes riscos: Crédito, Mercado, Liquidez e Operacional. Objetivando tornar as análises dos Riscos Corporativos e de Capital mais acuradas foram adotadas as seguintes ações para o período:

#### Risco de Mercado:

O Risco de Mercado é definido pela Resolução CMN nº 4.557/17 como possibilidade de ocorrência de perdas resultantes da flutuação nos valores de mercado de instrumentos detidos pela Instituição. Para identificar e mensurar as posições que expõem a instituição ao risco de mercado, o BANPARÁ calcula diariamente o VaR (*Value at Risk*) por tipo de carteira (*Banking Trading e Global*), por meio da metodologia EWMA (*Exponentially Weighted Moving Average*), para o horizonte de 1 du, com 95% de confiança. A

verificação da aderência do modelo é realizada trimestralmente pela técnica de *Backtesting Tunneling*, comparando as projeções com os resultados já obtidos, pelo conceito de túnel (amostra 252 du). Para a validação do modelo é esperado que o percentual de erro não exceda 10%, ou seja, duas vezes o comprimento do intervalo de confiança adotado (95%).

#### Análise de Sensibilidade:

O BANPARÁ acompanha o risco de taxas de juros para suas carteiras trading e banking, com estimativas da variação no valor de mercado das operações em relação ao Patrimônio de Referência, utilizando a aplicação de choque nas curvas de juros.

O Banpará classifica suas operações da seguinte forma:

- Classificados na carteira de negociação (trading book): composto por recursos de tesouraria negociados com compromisso de revenda e de recompra, lastreados em Títulos Públicos Federais (TPF), aplicações em cotas de fundos de investimento, TPF, títulos privados não classificados na modalidade mantidos até o vencimento e operações de câmbio (spot);

- Não classificados na carteira de negociação (banking book): constituído por operações de crédito comercial mantidas até o vencimento, operações de captação de recursos e demais operações do Banco sujeitas ao risco de mercado; inclusive TPF e títulos privados não classificados em trading, serão classificadas como banking, desde que observados o nível de liquidez do papel. Os títulos públicos e privados de baixa liquidez como CVS, CRIs e CCBs serão normalmente classificados na carteira banking.

A análise de sensibilidade é realizada de forma segregada, por carteira, no entanto existem operações que não fizeram parte do cálculo, pelo fato do indexador não gerar exposição ao risco de mercado ou porque a exposição não representa 5% do total das exposições banking, a exemplo das operações em moedas estrangeiras (spot) e operações de financiamento à exportação.

Para subsidiar a análise foram considerados os cenários, conforme instrução da CVM nº 475/08:

**Cenário1** – Para a carteira Banking os choques foram determinados a partir da diferença dos vértices 252 du e 1 du, tanto para a curva da taxa Pré, como da curva taxa TR. Para a curva Pré foi utilizado o choque de -137 Bp e para curva TR -109Bp. Considerando o prazo das operações compromissadas, os choques para carteira Trading foram definidos a partir da diferença entre a curva da taxa Pré 21 du e 1 du, o choque usado foi de -11Bp.

**Cenário2** – A partir do cenário base, aplicou-se o percentual de 25% na curva da taxa de vértice mais longo (252 du para Banking e 21 du para trading), deteriorando-se desta forma o cenário base em 25%. Foram aplicados os choques para carteira banking fator de risco Pré de 82Bp e TR 114Bp e para carteira trading fator de risco Pré 240Bp.

**Cenário3** – A partir do cenário base aplicou-se o percentual de 50% na curva da taxa de vértice mais longo (252 du para Banking e 21 du para trading), deteriorando-se desta forma o cenário base em 50%. Foram utilizados choques para carteira Banking fator de risco Pré de 302Bp e no fator de risco TR 338Bp, para carteira Trading fator de risco Pré, utilizou-se 491Bp.

O quadro abaixo demonstra o ganho ou perda no valor de mercado das operações, por carteira, considerando os fatores de riscos, considerando os cenários descritos acima:

Patrimônio de Referência			Junho/2017			Junho/2016		
			842.222.564,90			713.426.561,77		
Carteira	Fator de Risco	Conceito	Cenários (Mil)			Cenários (Mil)		
			1	2	3	1	2	3
Trading	Pré	Exposições sujeitas às variações das taxas de juros prefixadas e cupom de taxas de juros	(27)	(586)	(1.183)	133	(424)	(936)
	Pré		156.952	(89.713)	(316.013)	77.389	(233.477)	(505.149)
Banking	TR	Referencial: Títulos CVS e Poupança	6.046	(5.848)	(16.087)	(636)	(18.549)	(32.824)

O Banpará é tolerante a variação das taxas de mercado. Assim, mesmo em cenários em que as variações das curvas de preço possam gerar elevadas reduções no valor de mercado de suas posições, a instituição não pretende realizá-las. Além disso, o processo de gestão de riscos é contínuo, promovendo ações proativas para minimização de grandes impactos.

A administração dos instrumentos financeiros é efetuada por meio de políticas de controles, estabelecimento de estratégias de operações e de limites, bem como de outras técnicas de acompanhamento das posições.

#### Gerenciamento de capital:

O processo de gerenciamento de capital considera o monitoramento, controle, avaliação e planejamento de metas e da necessidade de capital, considerando os objetivos estratégicos do Banco, para fazer face aos riscos que a instituição está sujeita. Referente à exigência mínima de capital estabelecida pela autoridade monetária, que corresponde ao Índice de Basileia, cujo valor espelha a relação entre o capital da instituição e o volume de recursos exigidos para fazer face aos riscos de suas operações, o Banpará encerrou o 2º trimestre de 2017 com índice de 20,69% bem acima do requerimento mínimo de Patrimônio de Referência, que corresponde à aplicação do fator F ao montante total do RWA, o qual passou de 11% para 10,5%, considerando-se o 1,25% do Adicional de Capital Principal - ACP, estabelecido pelo Bacen, demonstrando um índice de solvabilidade capaz de cobrir suas exposições aos riscos, sem comprometer sua margem operacional.

O Banpará calcula apenas o ACPCONSERVAÇÃO em decorrência do fator multiplicador do Bacen (ACCPi-BRASIL) ser igual a zero, não se fazendo necessário o cálculo do ACPCONTRACÍCLICO e devido não estar enquadrado no Fator Anual de Importância Sistêmica - FIS, também não calcula o ACPSISTÊMICO.

O Banco mantém sua política, inclusive com informações adicionais sobre processos de controle de riscos no sítio: [www.banpara.br](http://www.banpara.br), na rota: O BANPARA/ Relação com Investidores/ Governança Corporativa/