

**BANCO DA AMAZÔNIA****PÁTRIA AMADA
BRASIL**
GOVERNO FEDERAL

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

28 Análise de sensibilidade

O Banco da Amazônia mantém um processo permanente de monitoramento de todas as posições expostas ao risco de mercado, sendo realizada rotineiramente a análise de sensibilidade, avaliando as posições da Instituição em condições extremas no cenário econômico.

Para risco de mercado, são utilizados três cenários, verificando-se primeiramente os resultados de VaR no cenário normal de mercado, em seguida é verificado um cenário em condições de estresse de 25% dos indicadores utilizados para projeção de MtM Estressado e por último, utiliza-se um estresse de 50%. No cálculo do estresse são utilizadas como parâmetros de referência as curvas de mercado: Cupom – BMF/IGPM, cupom – BMF/IPCA, cupom IGPM/NTN-Anbima, Cupom IPCA/NTN-Anbima, Cupom sujo USD, Cupom TR, PRÉ, USD brl.

Os níveis de estresse de 25% e 50% atribuídos para o modelo estão em conformidade com o requerido pela Instrução CVM nº 475/2008 e descritas a seguir:

Cenário 1 (Normal): A base deste cenário são as condições normais da atividade econômica. Utilizou-se a cotação Reais/Dólar a R\$3,8322 em 30/06/2019 (R\$3,87 em 30/06/2018) e a taxa DI de 1 ano no nível de 6,4% a.a. (6,4% a.a. em 30/06/2018).

Cenário 2 (Estresse de 25%): Foi aplicado estresse de 25% a maior sobre os fatores de risco do cenário normal. Os resultados projetados foram a cotação Reais/Dólar a R\$4,7903 em 30/06/2019 (R\$4,84 em 30/06/2018), e a taxa DI de 1 ano no nível de 8,0% a.a. (8,0% a.a. em 30/06/2018), com as oscilações dos demais fatores de risco representando choque paralelo de 25% nas respectivas curvas ou preços.

Cenário 3 (Estresse de 50%): Foi utilizado estresse de 50% sobre os dados do cenário normal, resultando, para a cotação Reais/Dólar, o valor de R\$5,7483 em 30/06/2019 (R\$5,81 em 30/06/2018) e para a taxa DI de 1 ano, o nível de 9,6% a.a. (9,59% a.a. em 30/06/2018), com as oscilações dos demais fatores de risco representando choque paralelo de 50% nas respectivas curvas ou preços. O quadro a seguir sintetiza a análise dos cenários de VaR dos ativos da Carteira de negociação e não negociação, conforme Instrução CVM nº 475/2008:

Exposições Financeiras		30.06.2019			30.06.2018		
		Cenários			Cenários		
Fatores de Risco	Definição	1	2	3	1	2	3
Prefixado	Exposições sujeitas à variação de taxas de juros prefixadas	1.446	(3.979)	(6.953)	(24)	-	-
Índice de preços	Exposições sujeitas à variação da taxa dos cupons de índice de preços	551	111.175	138.534	5027	(43.505)	(75.300)
Taxa de juros	Exposições sujeitas à variação da taxa de juros	26	(37.083)	(67.522)	(41)	(41.830)	(73.562)
Total		2.023	70.113	64.059	4.962	(85.335)	(148.862)

Os resultados apresentados refletem os impactos para cada cenário numa posição estática da carteira. Os três cenários demonstram que os fatores que apresentam maior risco estão nas alocações em índices de preços. No pior cenário tem-se uma perda no MtM da Tesouraria na ordem de R\$70 milhões correspondente ao estresse de 25% sobre o cenário normal de mercado (R\$148 milhões correspondente ao estresse de 50% em 30/06/2018).

Os resultados demonstrados ratificam o perfil conservador da carteira que, mesmo com choques paralelos de 25% e 50% sobre o cenário de referência (mercado), apresentaram baixo valor em risco das posições de TVM, sendo o maior fator de risco as posições em cupons de índice de preços. Essas posições correspondem a 0,97% do saldo total de aplicações da carteira de tesouraria do Banco.

29 Demonstração do resultado abrangente

	1º sem / 2019	1º sem / 2018
Resultado líquido do Período	59.191	(26.212)
Outros Resultados Abrangentes	(103.275)	47.163
Ajustes de Avaliação Patrimonial	(104.194)	46.428
Próprios – TVM Ajuste	6.762	(16.826)
Próprios – Delib.CVM nº 695/2012	(110.956)	63.254
Realização da Reserva de Reavaliação	919	735
IR e CSLL s/ Outros Lucros Abrangentes	114.915	(23.369)
Sobre a marcação a mercado	(2.705)	6.731
Sobre a realização da reserva	(367)	(331)
Sobre ajustes da Delib. CVM nº 695/2012	44.382	(29.769)
Sobre os Planos Saldados	73.605	-
Resultado Abrangente Líquido de IR e CSLL	11.640	23.794
Resultado Abrangente do Período	70.831	(2.418)

30) Outras informações**a) Avais e fianças prestados**

Os avais e fianças prestados pelo Banco apresentam a seguinte composição: