



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

Ministério da Fazenda



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:

	31.12.2014	31.12.2013
Carteira própria – livres	6.455.433	5.941.348
Títulos Públicos	4.734.430	4.357.270
Letras Financeiras do Tesouro	3.425.895	3.868.691
Letras do Tesouro Nacional	999.867	-
Notas do Tesouro Nacional	10.267	169.717
Certificados Financeiros do Tesouro	298.315	318.691
Títulos da Dívida Agrária	86	171
Títulos Privados	1.721.003	1.584.078
Debêntures	694.510	721.925
Cotas de Fundos de Investimento	154.229	166.347
Letras Financeiras	862.700	695.806
Notas Promissórias	9.564	-
Vinculados a operações compromissadas	310.733	34.130
Títulos Públicos	310.733	34.130
Letras Financeiras do Tesouro	310.733	34.130
Vinculados à prestação de garantias	78.737	14.970
Títulos Públicos	78.737	14.970
Letras Financeiras do Tesouro	78.737	14.970
TOTAL	6.844.903	5.990.448
Circulante	2.602.573	2.929.198
Não circulante	4.242.330	3.061.250

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 74,9% do total da Carteira (73,6% em 2013).

Dos títulos relacionados a prestação de garantias, R\$77.979 (R\$12.553 em 2013) estão vinculados às câmaras de compensação, BM&FBovespa e Câmara Interbancária de Pagamentos (CIP), e R\$758 (R\$2.417 em 2013) em garantia de processos judiciais.

Classificação dos títulos e valores mobiliários

a.1) Quanto ao vencimento

	2014						TOTAL
	Até 3 meses	3 a 12 meses	1 a 3 anos	3 a 5 anos	5 a 15 anos	Acima 15 anos	
1-Títulos para negociação⁽¹⁾	-	-	1.690.421	-	-	-	1.690.421
Títulos Públicos	-	-	1.690.421	-	-	-	1.690.421
Letras Financeiras do Tesouro	-	-	690.554	-	-	-	690.554
Letras do Tesouro Nacional	-	-	999.867	-	-	-	999.867
2-Títulos Disponíveis para venda	558.510	343.288	2.314.407	1.599.582	-	30.027	4.845.814
Títulos Públicos	276.259	12.650	1.362.877	1.473.025	-	-	3.124.811
Letras	276.259	12.650	1.362.877	1.473.025	-	-	3.124.811
Finanças do Tesouro	-	-	-	-	-	-	-
Títulos Privados	282.251	330.638	951.530	126.557	-	30.027	1.721.003
Debêntures	-	71.539	507.115	115.856	-	-	694.510
Cotas Fundos de Invest.-FIDC ⁽²⁾	-	-	21.623	10.701	-	30.027	62.351
Cotas Fundos de Invest.-FI REF	91.878	-	-	-	-	-	91.878
Outros Títulos - LF/NP	190.373	259.099	422.792	-	-	-	872.264
3-Títulos Mantidos até o vencimento	-	9.280	375	9	299.004	-	308.668
Títulos Públicos	-	9.280	375	9	299.004	-	308.668
Notas do Tesouro Nacional	-	9.194	375	9	689	-	10.267
Certificados Financeiros do Tesouro	-	-	-	-	298.315	-	298.315

Outros títulos públicos - TDA	-	86	-	-	-	-	86
TOTAL 2014	558.510	352.568	4.005.203	1.599.591	299.004	30.027	6.844.903

TOTAL 2013 1.575.627 730.392 873.459 2.294.627 516.343 - 5.990.448

(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

	31.12.2014		31.12.2013	Ajustes	31.12.2014
	Custo	Mercado			
Para negociação	1.695.902	1.690.421	283	(5.764)	(5.481)
Letras Financeiras do Tesouro	690.698	690.554	283	(427)	(144)
Letras do Tesouro Nacional	1.005.204	999.867	-	(5.337)	(5.337)
Disponíveis para venda	4.848.851	4.845.814	692	(3.729)	(3.037)
Letras Financeiras do Tesouro	3.126.506	3.124.811	(1.037)	(658)	(1.695)
Notas do Tesouro Nacional	-	-	1.963	(1.963)	-
Debêntures	695.175	694.510	832	(1.497)	(665)
Cotas de Fundos de Investimentos - FIDC	63.037	62.351	(1.066)	380	(686)
Cotas de Fundos de Investimentos - FI REF	91.878	91.878	-	-	-
Outros Títulos Privados - LF	872.255	872.264	-	9	9
Mantidos até o vencimento	308.668	308.668	-	-	-
Notas do Tesouro Nacional	10.267	10.267	-	-	-
Certificados Financeiros do Tesouro	298.315	298.315	-	-	-
Outros títulos públicos - TDA	86	86	-	-	-

Do total aplicado em Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios (FIDC), há o montante de R\$1.225 aplicado no fundo administrado pelo Banco BVA (R\$1.607 em 2013), 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\$1.038 em 2013) 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\$43.059 (R\$44.624 em 2013).

Do total das CFT's, o montante de R\$286.006 (R\$305.541 em 2013) foi recebido pelo Banco no Programa de Fortalecimento das Instituições Financeiras Federais instituído pela Medida Provisória nº 2.196, de 27 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\$40.657 (R\$42.248 em 2013).

No exercício de 2014, não houve reclassificações entre categorias nos títulos e valores mobiliários.

O resultado com TVM totalizou no exercício R\$728.729 (R\$598.663 em 2013).

b) Instrumentos Financeiros Derivativos

O Banco da Amazônia se utiliza de instrumentos financeiros derivativos para gerenciar suas posições e atender às necessidades, de acordo com limites e alçadas estabelecidas em seus normativos, possuindo ferramentas e sistemas adequados ao gerenciamento desses instrumentos, utilizando metodologias estatísticas e simulação 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 de ações e de commodities.

Instrumentos Financeiros Derivativos classificados como *hedge* de Risco de Mercado

	31.12.2014	31.12.2013
Instrumento de Hedge	Ajuste a Valor de Mercado	Ajuste a Valor de Mercado
Futuro de Juros	275.756	-
Total	275.756	-

Margem dada em garantia de operações com Instrumentos Financeiros Derivativos

	31.12.2014	31.12.2013
Especificação		
Letras Financeiras do Tesouro	64.120	-
Total	64.120	-

Resultado com Instrumentos Financeiros Derivativos

	31.12.2014	31.12.2013
Especificação		
Ajustes Financeiras Acumulados	(208)	-
Total	(208)	-