



BANCO DO ESTADO DO PARÁ S.A. - COMPANHIA ABERTA • CNPJ 04.913.711/0001-08 • NIRE 15300000114  
Avenida Presidente Vargas, nº 251, Centro – CEP 66.010-000 – Belém-Pará



#### Rendas de aplicações interfinanceiras de liquidez

Títulos	2º Semestre	31.12.2017	31.12.2016
Posição Bancada	26.352	46.378	37.787
Posição Financiada	2.326	10.919	25.903
Depósitos Interfinanceiros	13.211	31.356	34.543
<b>Total</b>	<b>41.889</b>	<b>88.653</b>	<b>98.233</b>

As rendas de aplicações interfinanceiras de liquidez estão classificadas na demonstração do resultado como resultado de aplicações interfinanceiras e operações com títulos e valores mobiliários.

#### 5. TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS

##### a. Classificação por tipo de papel

Títulos	31.12.2017	31.12.2016
<b>Livres</b>	<b>900.611</b>	<b>299.641</b>
Letras Financeiras do Tesouro	582.399	109.821
CVS	122.889	135.605
Letras imobiliárias	192.715	51.636
Cotas de fundos de investimento em participações (i)	2.608	2.579
<b>Vinculados a operações compromissadas</b>	<b>33.577</b>	<b>400.349</b>
Letras Financeiras do Tesouro	33.577	400.349
<b>Vinculados à prestação de garantia</b>	<b>7.424</b>	<b>6.744</b>
Letras Financeiras do Tesouro	7.424	6.744
<b>Total</b>	<b>941.612</b>	<b>706.734</b>
<b>Circulante</b>	<b>816.115</b>	<b>568.550</b>
<b>Realizável em longo prazo</b>	<b>125.497</b>	<b>138.184</b>

(i) Objetivando promover o desenvolvimento da Amazônia, o Banco investe no Fundo de Investimento em Participações em Empresas Sustentáveis na Amazônia (FIP Amazônia), cujo objetivo é promover o desenvolvimento sustentável da Amazônia proporcionando desenvolvimento social, econômico e ambiental. O regulamento do fundo estabelece que o seu prazo de duração é de 12 anos podendo ser prorrogado por mais 3 anos.

##### b. Classificação por categoria e vencimento

Títulos	Meses		Anos			31.12.2017	31.12.2016
	Até 3	3 a 12	1 a 3	3 a 5	5 a 15	TOTAL	TOTAL
<b>Títulos para negociação (i)</b>	<b>153.555</b>	<b>33.935</b>	<b>216.369</b>	<b>358.434</b>	<b>53.822</b>	<b>816.115</b>	<b>568.550</b>
<b>Títulos públicos</b>	<b>153.555</b>	<b>33.935</b>	<b>216.369</b>	<b>358.434</b>	<b>53.822</b>	<b>816.115</b>	<b>568.550</b>
Letras de crédito imobiliário	153.555	33.935	5.225	-	-	192.715	51.636
Letras financeiras tesouro	-	-	211.144	358.434	53.822	623.400	516.914
<b>Títulos Mantidos até o vencimento (ii)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>125.497</b>	<b>125.497</b>	<b>138.184</b>
<b>Títulos públicos</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>122.889</b>	<b>122.889</b>	<b>135.605</b>
CVS	-	-	-	-	122.889	122.889	135.605
<b>Títulos privados</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2.608</b>	<b>2.608</b>	<b>2.579</b>
Cotas de fundos de invest. em participações	-	-	-	-	2.608	2.608	2.579
<b>TOTAL 31.12.2017</b>	<b>153.555</b>	<b>33.935</b>	<b>216.369</b>	<b>358.434</b>	<b>179.319</b>	<b>941.612</b>	<b>-</b>
<b>TOTAL 31.12.2016</b>	<b>51.636</b>	<b>-</b>	<b>5.694</b>	<b>409.434</b>	<b>239.970</b>	<b>-</b>	<b>706.734</b>

(i) Os Títulos e Valores Mobiliários classificados para negociação são apresentados no ativo circulante, conforme parágrafo único do art. 7º da Circular BACEN nº 3.068/2001.

(ii) Não houve reclassificação entre categorias nas datas-base de 31 de Dezembro de 2017 e 2016.

Em conformidade com a Circular BACEN nº 3.068/2001, o Banco declara ter capacidade financeira e intenção de manter, até o vencimento, os títulos classificados na categoria "mantidos até o vencimento".

#### c. Quanto aos ajustes de marcação a mercado

Títulos	31.12.2017		31.12.2016		31.12.2017	31.12.2016
	Custo Amortizado	Mercado	Custo Amortizado	Mercado	Ajuste	Ajuste
<b>Para negociação</b>	<b>816.833</b>	<b>816.115</b>	<b>570.332</b>	<b>568.550</b>	<b>(718)</b>	<b>(1.782)</b>
Letras de crédito imobiliário	193.231	192.714	52.178	51.636	(517)	(542)
Letras financeiras do tesouro	623.602	623.401	518.154	516.914	(201)	(1.240)
<b>Mantidos até o vencimento (i)</b>	<b>125.497</b>	<b>125.497</b>	<b>138.184</b>	<b>138.184</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
CVS	122.889	122.889	135.605	135.605	-	-
Cotas de fundos de invest. em participações	2.608	2.608	2.579	2.579	-	-

(i) Os títulos mantidos até o vencimento são registrados pelo custo de aquisição, e acrescidos pelos rendimentos auferidos em contrapartida ao resultado do período.

#### d. Quanto aos níveis de informação na mensuração ao valor justo

Descrição	Saldo		
	31.12.2017	Nível 1	Nível 2
Letras de crédito imobiliário	192.714	-	192.714
Letras financeiras do tesouro	623.401	623.401	-
<b>Total</b>	<b>816.115</b>	<b>623.401</b>	<b>192.714</b>

Descrição	Saldo		
	31.12.2016	Nível 1	Nível 2
Letras de crédito imobiliário	51.636	-	51.636
Letras financeiras do tesouro	516.914	516.914	-
<b>Total</b>	<b>568.550</b>	<b>516.914</b>	<b>51.636</b>

Conforme os níveis de informação na mensuração ao valor justo, as técnicas de avaliação utilizadas pelo Banco são as seguintes:

**Nível 1** – são usados preços cotados em mercados ativos para instrumentos financeiros idênticos. Um instrumento financeiro é considerado como cotado em um mercado ativo se os preços cotados estiverem prontos e regularmente disponíveis, e se esses preços representarem transações de mercado reais e que ocorrem regularmente numa base em que não exista relacionamento entre as partes.

**Nível 2** – são usadas outras informações disponíveis, exceto aquelas do Nível 1, onde os preços são cotados em mercados não ativos ou para ativos e passivos similares, ou são usadas outras informações que estão disponíveis ou que podem ser corroboradas pelas informações observadas no mercado para suportar a avaliação dos ativos e passivos.

#### e. Rendas com títulos e valores e mobiliários

Contas	2º Semestre	31.12.2017	31.12.2016
Rendas de títulos de renda fixa	32.720	71.057	77.055
Rendas com cotas de fundos de investimento	29	48	204
Ajustes positivos (negativos) ao valor de mercado TVM	814	942	(1.624)
<b>Total</b>	<b>33.563</b>	<b>72.047</b>	<b>75.635</b>

#### 6. RELAÇÕES INTERFINANCEIRAS

Contas	31.12.2017	31.12.2016
Direitos junto à participação de sistemas de liquidação	163	-
Relações com correspondentes	-	858
Reservas compulsórias em espécie – BACEN (a)	31.873	31.677
Recolhimentos sobre depósitos de poupança – BACEN (b)	100.707	-
SFH – Créditos junto ao FCVS (c)	55.827	58.204
Depósitos compulsórios – Crédito rural Res. Bacen nº 3.310/2005	44.455	47.470
<b>Total</b>	<b>233.025</b>	<b>138.209</b>
<b>Circulante</b>	<b>177.198</b>	<b>80.005</b>
<b>Realizável em longo prazo</b>	<b>55.827</b>	<b>58.204</b>