

ANEXO VI

SÉRIES HISTÓRICAS

H - Títulos federais em poder do público a vencer em 12 meses por tipo de rentabilidade

Em R\$ bilhões

Mês	Prefixados		Taxa Selic		Índices de preços		Câmbio		TR		Outros		Total	
Dezembro/99	39,75	100,00%	146,48	58,20%	2,03	8,26%	53,31	52,94%	0,91	3,79%	0,02	3,34%	242,51	54,94%
Janeiro/00	42,80	100,00%	150,64	58,60%	2,05	8,29%	54,18	53,09%	1,48	5,75%	0,10	12,23%	251,24	55,45%
Fevereiro/00	47,29	100,00%	138,96	53,70%	2,13	8,30%	53,82	54,60%	1,49	5,77%	0,10	12,70%	243,78	53,36%
Março/00	51,22	90,37%	115,74	45,05%	2,14	8,31%	53,85	54,86%	1,50	5,78%	0,10	13,22%	224,55	48,37%
Abril/00	62,18	96,13%	99,82	39,38%	2,16	8,25%	55,77	54,94%	1,52	5,75%	0,10	13,79%	221,54	46,84%
Mai/00	61,27	100,00%	104,79	39,20%	2,17	8,11%	51,53	49,28%	1,53	5,76%	0,48	70,82%	221,77	45,53%
Junho/00	65,44	100,00%	108,68	40,41%	3,49	13,05%	54,64	52,71%	1,54	5,83%	0,46	69,37%	234,24	47,63%
Julho/00	66,08	96,30%	120,30	44,71%	3,58	12,89%	55,22	53,75%	1,56	5,90%	0,43	69,96%	247,17	49,91%
Agosto/00	69,61	95,93%	113,18	43,10%	3,79	13,30%	55,18	52,59%	1,57	6,33%	0,40	68,30%	243,73	49,34%
Setembro/00	70,22	90,69%	115,39	43,58%	3,81	13,18%	55,76	52,60%	1,59	6,35%	0,37	66,38%	247,14	49,17%
Outubro/00	74,15	93,17%	106,50	40,41%	3,87	13,07%	56,61	51,52%	1,31	5,45%	0,30	71,82%	242,74	47,88%
Novembro/00	66,50	89,21%	99,56	37,66%	3,78	12,67%	56,60	49,75%	1,31	5,46%	0,27	69,25%	228,02	44,98%
Dezembro/00	72,95	96,75%	95,53	35,81%	3,65	12,03%	51,22	45,03%	1,31	5,46%	0,24	66,47%	224,90	44,04%
Janeiro/01	64,57	87,16%	84,40	32,03%	4,07	11,46%	49,05	42,53%	1,33	5,49%	0,21	65,83%	203,62	39,70%
Fevereiro/01	65,10	90,57%	89,24	33,65%	4,26	11,35%	40,95	34,20%	1,31	5,40%	0,17	61,20%	201,02	38,75%
Março/01	67,74	89,76%	104,55	38,87%	4,53	11,81%	42,22	32,70%	1,34	5,49%	0,14	56,42%	220,51	41,10%
Abril/01	61,05	89,79%	110,24	39,58%	4,34	11,14%	43,56	32,04%	1,34	4,96%	0,11	49,00%	220,63	40,22%
Mai/01	56,13	88,86%	90,21	32,91%	4,52	11,03%	56,32	37,78%	1,34	4,96%	0,07	39,48%	208,60	37,61%
Junho/01	55,78	88,68%	73,59	25,22%	3,30	7,94%	56,40	36,23%	1,36	4,72%	0,07	39,48%	190,50	32,80%
Julho/01	59,88	98,71%	49,44	16,06%	3,20	7,99%	62,12	37,47%	1,37	5,97%	0,07	42,85%	176,07	29,48%
Agosto/01	57,34	98,64%	39,42	12,75%	3,29	7,95%	69,00	39,49%	1,37	6,07%	0,07	42,86%	170,49	28,13%
Setembro/01	56,40	98,60%	34,44	11,10%	3,48	8,32%	81,59	41,35%	1,38	6,14%	0,07	42,87%	177,36	28,19%
Outubro/01	52,09	98,47%	34,71	11,17%	3,42	8,01%	95,47	45,62%	0,97	4,55%	0,02	24,02%	186,68	29,30%
Novembro/01	50,06	97,79%	35,00	11,09%	3,46	7,92%	88,41	45,38%	0,97	4,52%	0,02	23,82%	177,92	28,38%
Dezembro/01	47,19	96,73%	35,39	10,74%	7,33	16,81%	82,20	46,03%	0,97	4,14%	0,02	23,62%	173,12	27,74%
Janeiro/02	44,65	92,90%	35,48	10,62%	8,09	15,74%	86,08	46,17%	0,97	6,50%	0,02	16,76%	175,30	27,60%
Fevereiro/02	43,27	91,32%	32,91	9,88%	8,37	15,46%	84,50	46,61%	0,98	6,25%	0,11	50,79%	170,12	26,93%
Março/02	50,20	88,34%	18,36	5,73%	8,45	15,61%	84,70	47,16%	0,98	6,50%	0,11	50,71%	162,80	25,99%
Abril/02	61,53	99,40%	22,45	6,93%	8,65	15,34%	85,34	48,56%	0,99	6,54%	0,11	50,62%	179,06	28,28%
Mai/02	60,61	99,38%	35,30	10,79%	8,79	15,40%	86,93	48,46%	0,98	6,72%	0,11	50,42%	192,71	30,14%
Junho/02	55,81	99,32%	80,63	24,49%	8,75	15,02%	98,64	50,51%	1,15	7,88%	0,11	50,45%	245,08	37,49%
Julho/02	51,35	99,25%	106,63	29,83%	9,32	15,39%	95,12	49,50%	1,16	9,40%	0,11	53,10%	263,69	39,10%
Agosto/02	47,78	99,18%	134,32	38,66%	9,52	15,48%	71,63	46,79%	1,17	9,43%	0,14	58,86%	264,55	42,48%
Setembro/02	42,63	99,07%	143,82	41,27%	9,49	15,03%	89,86	46,97%	1,18	9,41%	0,15	60,25%	287,13	43,58%
Outubro/02	40,64	99,01%	142,16	41,48%	10,39	15,39%	74,04	44,01%	1,00	8,01%	0,04	35,78%	268,28	42,44%
Novembro/02	27,46	98,52%	168,43	46,25%	11,57	14,94%	56,12	37,59%	0,93	7,40%	0,04	35,72%	264,54	41,89%
Dezembro/02	13,22	96,77%	185,83	49,02%	6,79	8,68%	49,16	35,25%	0,91	7,11%	-	0,00%	255,92	41,07%
Janeiro/03	12,15	99,82%	203,83	51,27%	7,21	9,09%	45,22	33,52%	0,92	7,15%	-	0,00%	269,34	42,29%

ANEXO VI

SÉRIES HISTÓRICAS

H - Títulos federais em poder do público a vencer em 12 meses por tipo de rentabilidade

Em R\$ bilhões

Mês	Prefixados		Taxa Selic		Índices de preços		Câmbio		TR		Outros		Total	
Fevereiro/03	12,78	99,82%	200,05	49,51%	7,72	9,38%	46,42	34,94%	0,92	7,13%	-	0,00%	267,90	41,54%
Março/03	15,66	99,86%	186,36	44,87%	8,62	10,25%	46,84	38,53%	0,93	7,15%	-	0,00%	258,41	39,77%
Abril/03	11,53	93,57%	175,76	40,30%	8,65	10,11%	35,17	36,17%	0,93	7,10%	-	0,00%	232,05	36,01%
Maió/03	18,33	84,92%	178,66	40,23%	8,89	10,29%	34,21	35,87%	1,28	9,63%	-	0,00%	241,39	36,53%
Junho/03	24,71	82,41%	169,58	37,70%	9,03	10,51%	32,30	35,78%	0,93	6,92%	-	0,00%	236,56	35,34%
Julho/03	39,92	91,72%	149,42	32,58%	8,93	10,47%	31,21	35,07%	0,90	6,65%	-	0,00%	230,39	33,39%
Agosto/03	46,64	90,34%	148,41	32,40%	9,51	11,02%	32,98	37,86%	0,92	7,11%	-	0,00%	238,47	34,27%
Setembro/03	55,63	86,89%	141,05	30,85%	10,18	11,28%	32,03	38,48%	0,89	6,89%	-	0,00%	239,80	33,88%
Outubro/03	61,68	86,91%	136,03	29,49%	10,34	11,09%	34,77	43,64%	0,78	6,12%	-	0,00%	243,61	33,94%
Novembro/03	71,09	86,61%	132,75	29,02%	10,28	10,90%	37,36	45,74%	0,73	5,66%	-	0,00%	252,22	34,63%
Dezembro/03	78,69	85,97%	130,73	29,12%	10,66	10,76%	37,75	47,98%	0,67	5,12%	0,02	49,75%	258,52	35,34%
Janeiro/04	85,36	92,08%	125,05	27,68%	10,73	10,74%	41,18	51,70%	0,73	5,49%	0,02	60,32%	263,06	35,68%
Fevereiro/04	92,02	91,14%	140,86	31,24%	11,06	10,82%	39,09	51,67%	0,78	5,85%	0,01	58,15%	283,82	38,19%
Março/04	90,91	77,66%	163,89	35,96%	10,15	9,81%	33,71	48,04%	0,84	6,26%	0,02	60,31%	299,51	39,42%
Abril/04	105,70	87,18%	166,17	36,28%	10,36	9,71%	31,73	46,62%	0,84	6,23%	0,02	60,31%	314,82	41,01%
Maió/04	107,21	87,51%	163,42	37,72%	10,58	9,65%	30,93	44,60%	0,87	6,39%	0,02	60,31%	313,04	41,83%
Junho/04	111,53	87,44%	168,40	38,61%	10,83	9,56%	28,98	43,01%	0,76	5,53%	0,02	57,67%	320,53	42,28%
Julho/04	107,29	93,38%	168,78	37,32%	15,58	13,58%	25,59	40,54%	0,79	5,56%	0,01	57,67%	318,05	41,89%
Agosto/04	118,69	93,55%	181,33	40,70%	16,59	14,17%	21,17	36,60%	0,90	6,20%	0,01	74,44%	338,68	44,46%
Setembro/04	125,53	93,20%	198,27	44,10%	16,82	14,24%	18,59	34,25%	0,91	6,19%	0,01	74,44%	360,12	46,69%
Outubro/04	122,67	90,76%	199,11	43,45%	16,70	14,06%	16,70	33,75%	1,19	8,01%	0,01	74,44%	356,38	45,90%
Novembro/04	132,92	90,52%	188,32	41,11%	16,86	14,07%	17,86	39,22%	1,23	8,43%	0,01	74,44%	357,21	45,51%
Dezembro/04	146,98	90,30%	183,86	39,71%	26,24	21,74%	14,68	35,17%	1,56	7,07%	0,01	59,69%	373,33	46,08%
Janeiro/05	148,44	95,97%	176,12	35,83%	26,16	21,73%	10,90	28,82%	1,65	7,39%	0,01	79,64%	363,29	43,94%
Fevereiro/05	156,64	90,67%	171,31	34,72%	26,33	21,78%	9,37	26,05%	1,65	7,37%	0,01	79,64%	365,30	43,21%
Março/05	158,67	84,39%	178,16	35,35%	26,43	21,62%	10,48	28,38%	1,65	7,35%	0,01	79,64%	375,40	42,97%

Obs.: Valores apurados com base na posição de carteira avaliada pelo preço da curva de rentabilidade intrínseca dos títulos, considerando-se os pagamentos intermediários em suas datas efetivas.
 Percentual em relação ao total dos títulos a vencer com o mesmo tipo de rentabilidade.