

## ANEXO V

### **ESTRUTURA DE VENCIMENTOS DOS TÍTULOS FEDERAIS** **EM PODER DO PÚBLICO POR TIPO DE RENTABILIDADE**

#### **Prefixados**

Em R\$ bilhões

Mês	Até 1 ano		De 1 a 2 anos		De 2 a 3 anos		De 3 a 4 anos		De 4 a 5 anos		Acima de 5 anos		Total	
	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%
<b>Dezembro/99</b>	39,75	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	39,75	100,00%
<b>Dezembro/00</b>	72,95	96,75%	2,45	3,25%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	75,40	100,00%
<b>Dezembro/01</b>	47,20	96,73%	1,60	3,27%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	48,79	100,00%
<b>Dezembro/02</b>	13,21	96,77%	0,44	3,22%	0,00	0,01%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	13,66	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	78,69	85,97%	12,50	13,65%	0,03	0,04%	0,03	0,03%	0,28	0,30%	0,00	0,00%	91,53	100,00%
<b>Junho/04</b>	111,53	87,44%	14,98	11,74%	0,10	0,08%	0,93	0,73%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	127,55	100,00%
<b>Julho/04</b>	107,29	93,38%	6,61	5,75%	0,09	0,08%	0,90	0,79%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	114,90	100,00%
<b>Agosto/04</b>	118,69	93,55%	7,17	5,65%	0,10	0,08%	0,92	0,72%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	126,87	100,00%
<b>Setembro/04</b>	125,53	93,20%	8,13	6,03%	0,10	0,07%	0,93	0,69%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	134,68	100,00%
<b>Outubro/04</b>	122,67	90,76%	11,22	8,30%	0,12	0,09%	1,15	0,85%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	135,16	100,00%
<b>Novembro/04</b>	132,92	90,52%	12,35	8,41%	0,15	0,10%	1,42	0,97%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	146,84	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	146,98	90,30%	13,54	8,32%	0,21	0,13%	2,03	1,25%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	162,76	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	148,44	95,97%	3,56	2,30%	2,66	1,72%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	154,67	100,00%
<b>Fevereiro/05</b>	156,64	90,67%	12,73	7,37%	3,12	1,81%	0,03	0,01%	0,24	0,14%	0,00	0,00%	172,75	100,00%
<b>Março/05</b>	158,67	84,39%	25,57	13,60%	3,33	1,77%	0,04	0,02%	0,40	0,21%	0,00	0,00%	188,02	100,00%
<b>Abril/05</b>	150,81	85,23%	22,04	12,45%	3,62	2,05%	0,05	0,03%	0,44	0,25%	0,00	0,00%	176,96	100,00%
<b>Mai/05</b>	151,52	77,38%	39,92	20,39%	3,77	1,92%	0,06	0,03%	0,55	0,28%	0,00	0,00%	195,82	100,00%

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.

## ANEXO V

### **ESTRUTURA DE VENCIMENTOS DOS TÍTULOS FEDERAIS** **EM PODER DO PÚBLICO POR TIPO DE RENTABILIDADE**

#### **Taxa Selic**

Em R\$ bilhões

Mês	Até 1 ano		De 1 a 2 anos		De 2 a 3 anos		De 3 a 4 anos		De 4 a 5 anos		Acima de 5 anos		Total	
	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%
<b>Dezembro/99</b>	146,48	58,20%	57,92	23,01%	6,47	2,57%	5,56	2,21%	5,64	2,24%	29,60	11,76%	251,68	100,00%
<b>Dezembro/00</b>	95,53	35,81%	32,84	12,31%	77,86	29,18%	21,20	7,95%	8,35	3,13%	31,03	11,63%	266,81	100,00%
<b>Dezembro/01</b>	35,39	10,74%	93,44	28,36%	44,66	13,55%	31,72	9,63%	97,17	29,49%	27,08	8,22%	329,46	100,00%
<b>Dezembro/02</b>	185,83	49,02%	52,91	13,96%	35,54	9,38%	76,43	20,16%	16,69	4,40%	11,67	3,08%	379,07	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	130,73	29,12%	135,18	30,10%	116,17	25,87%	44,29	9,86%	12,95	2,88%	9,70	2,16%	449,03	100,00%
<b>Junho/04</b>	168,40	38,61%	145,53	33,37%	73,16	16,77%	34,07	7,81%	5,36	1,23%	9,61	2,20%	436,13	100,00%
<b>Julho/04</b>	168,78	37,32%	168,81	37,33%	65,80	14,55%	33,74	7,46%	5,43	1,20%	9,69	2,14%	452,25	100,00%
<b>Agosto/04</b>	181,33	40,70%	157,95	35,45%	58,09	13,04%	33,12	7,43%	5,29	1,19%	9,78	2,19%	445,55	100,00%
<b>Setembro/04</b>	198,27	44,10%	150,82	33,55%	67,87	15,10%	17,93	3,99%	4,81	1,07%	9,84	2,19%	449,55	100,00%
<b>Outubro/04</b>	199,11	43,45%	165,12	36,03%	61,39	13,40%	17,85	3,90%	4,87	1,06%	9,91	2,16%	458,25	100,00%
<b>Novembro/04</b>	188,32	41,11%	178,52	38,97%	61,08	13,33%	15,27	3,33%	6,49	1,42%	8,43	1,84%	458,12	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	183,86	39,71%	187,34	40,46%	61,48	13,28%	15,82	3,42%	5,97	1,29%	8,51	1,84%	462,99	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	176,12	35,83%	202,62	41,22%	82,19	16,72%	16,61	3,38%	5,49	1,12%	8,51	1,73%	491,54	100,00%
<b>Fevereiro/05</b>	171,31	34,72%	196,96	39,92%	94,72	19,20%	16,28	3,30%	5,55	1,13%	8,58	1,74%	493,39	100,00%
<b>Março/05</b>	178,16	35,35%	201,61	40,00%	89,53	17,77%	23,79	4,72%	2,26	0,45%	8,63	1,71%	503,99	100,00%
<b>Abril/05</b>	185,43	35,87%	194,58	37,64%	99,62	19,27%	26,05	5,04%	2,62	0,51%	8,70	1,68%	517,01	100,00%
<b>Mai/05</b>	199,67	38,88%	166,24	32,37%	107,22	20,88%	28,71	5,59%	2,94	0,57%	8,78	1,71%	513,57	100,00%

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.

## ANEXO V

### **ESTRUTURA DE VENCIMENTOS DOS TÍTULOS FEDERAIS** **EM PODER DO PÚBLICO POR TIPO DE RENTABILIDADE** **Índice de Preços**

Em R\$ bilhões

Mês	Até 1 ano		De 1 a 2 anos		De 2 a 3 anos		De 3 a 4 anos		De 4 a 5 anos		Acima de 5 anos		Total	
	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%
<b>Dezembro/99</b>	2,03	8,26%	2,65	10,76%	1,29	5,22%	0,81	3,30%	2,05	8,34%	15,79	64,11%	24,63	100,00%
<b>Dezembro/00</b>	3,65	12,03%	5,19	17,13%	0,70	2,31%	1,67	5,51%	6,92	22,82%	12,19	40,20%	30,32	100,00%
<b>Dezembro/01</b>	7,33	16,81%	2,89	6,62%	1,89	4,34%	9,60	22,01%	2,81	6,44%	19,10	43,79%	43,63	100,00%
<b>Dezembro/02</b>	6,79	8,68%	7,57	9,69%	20,74	26,54%	4,09	5,24%	1,43	1,83%	37,54	48,03%	78,17	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	10,66	10,76%	24,13	24,36%	8,58	8,66%	4,49	4,53%	11,76	11,87%	39,45	39,82%	99,07	100,00%
<b>Junho/04</b>	10,83	9,56%	23,99	21,17%	11,34	10,01%	16,46	14,53%	6,97	6,15%	43,70	38,57%	113,29	100,00%
<b>Julho/04</b>	15,58	13,58%	18,90	16,47%	11,87	10,34%	16,75	14,60%	7,32	6,38%	44,34	38,64%	114,75	100,00%
<b>Agosto/04</b>	16,59	14,17%	21,29	18,19%	8,31	7,10%	17,62	15,06%	7,46	6,37%	45,77	39,11%	117,04	100,00%
<b>Setembro/04</b>	16,82	14,24%	21,22	17,96%	8,33	7,05%	18,15	15,37%	7,53	6,37%	46,09	39,01%	118,14	100,00%
<b>Outubro/04</b>	16,70	14,06%	21,19	17,84%	8,38	7,06%	17,97	15,13%	7,72	6,50%	46,80	39,41%	118,75	100,00%
<b>Novembro/04</b>	16,86	14,07%	21,17	17,68%	8,53	7,12%	18,20	15,19%	7,75	6,47%	47,29	39,47%	119,80	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	26,24	21,74%	13,33	11,04%	6,35	5,26%	18,65	15,45%	7,91	6,55%	48,22	39,95%	120,71	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	26,16	21,73%	13,32	11,06%	6,31	5,24%	18,76	15,59%	7,90	6,56%	47,93	39,81%	120,38	100,00%
<b>Fevereiro/05</b>	26,33	21,78%	12,99	10,74%	6,34	5,24%	18,80	15,55%	8,03	6,64%	48,41	40,04%	120,90	100,00%
<b>Março/05</b>	26,43	21,62%	12,98	10,62%	6,42	5,25%	19,10	15,62%	8,09	6,62%	49,22	40,27%	122,23	100,00%
<b>Abril/05</b>	26,71	21,68%	12,93	10,50%	20,37	16,53%	5,02	4,07%	8,23	6,68%	49,96	40,54%	123,22	100,00%
<b>Mai/05</b>	26,84	21,71%	13,05	10,55%	20,38	16,48%	8,74	7,07%	4,54	3,67%	50,08	40,51%	123,63	100,00%

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.

## ANEXO V

### **ESTRUTURA DE VENCIMENTOS DOS TÍTULOS FEDERAIS** **EM PODER DO PÚBLICO POR TIPO DE RENTABILIDADE**

#### **Câmbio**

Em R\$ bilhões

Mês	Até 1 ano		De 1 a 2 anos		De 2 a 3 anos		De 3 a 4 anos		De 4 a 5 anos		Acima de 5 anos		Total	
	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%
<b>Dezembro/99</b>	53,31	52,94%	40,78	40,49%	2,69	2,67%	1,28	1,27%	1,58	1,57%	1,07	1,06%	100,71	100,00%
<b>Dezembro/00</b>	51,22	45,03%	21,91	19,26%	20,80	18,29%	9,14	8,04%	1,16	1,02%	9,50	8,35%	113,74	100,00%
<b>Dezembro/01</b>	82,20	46,03%	46,76	26,18%	29,18	16,34%	5,73	3,21%	6,23	3,49%	8,47	4,74%	178,58	100,00%
<b>Dezembro/02</b>	49,16	35,25%	45,53	32,64%	15,52	11,13%	9,49	6,81%	0,18	0,13%	19,59	14,05%	139,47	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	37,75	47,98%	14,39	18,28%	11,72	14,89%	1,33	1,69%	2,16	2,74%	11,34	14,42%	78,67	100,00%
<b>Junho/04</b>	28,98	43,01%	10,71	15,90%	11,45	17,00%	1,37	2,03%	2,26	3,36%	12,61	18,71%	67,37	100,00%
<b>Julho/04</b>	25,59	40,54%	10,51	16,64%	11,24	17,81%	2,39	3,78%	1,09	1,73%	12,32	19,51%	63,14	100,00%
<b>Agosto/04</b>	21,17	36,60%	10,27	17,75%	11,01	19,03%	2,34	4,04%	1,07	1,84%	11,99	20,73%	57,84	100,00%
<b>Setembro/04</b>	18,59	34,25%	12,49	23,01%	8,19	15,08%	2,29	4,22%	1,04	1,91%	11,68	21,52%	54,27	100,00%
<b>Outubro/04</b>	16,70	33,75%	13,76	27,81%	4,34	8,77%	2,28	4,61%	0,97	1,96%	11,43	23,10%	49,48	100,00%
<b>Novembro/04</b>	17,86	39,22%	12,28	26,97%	1,32	2,90%	2,20	4,82%	0,93	2,04%	10,95	24,05%	45,54	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	14,68	35,17%	12,05	28,86%	1,28	3,08%	2,15	5,15%	0,91	2,17%	10,67	25,57%	41,74	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	10,90	28,82%	12,03	31,80%	1,28	3,38%	2,09	5,52%	0,91	2,40%	10,62	28,08%	37,83	100,00%
<b>Fevereiro/05</b>	9,37	26,05%	11,78	32,74%	1,28	3,56%	2,09	5,80%	0,91	2,52%	10,55	29,33%	35,98	100,00%
<b>Março/05</b>	10,48	28,38%	11,20	30,31%	1,31	3,55%	2,15	5,82%	0,93	2,52%	10,87	29,42%	36,94	100,00%
<b>Abril/05</b>	9,85	28,54%	10,49	30,37%	1,23	3,56%	2,03	5,89%	0,84	2,42%	10,09	29,23%	34,53	100,00%
<b>Mai/05</b>	9,22	28,26%	9,89	30,31%	1,17	3,60%	1,95	5,97%	0,79	2,43%	9,60	29,44%	32,62	100,00%

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.

## ANEXO V

### **ESTRUTURA DE VENCIMENTOS DOS TÍTULOS FEDERAIS** **EM PODER DO PÚBLICO POR TIPO DE RENTABILIDADE**

#### **TR**

Em R\$ bilhões

Mês	Até 1 ano		De 1 a 2 anos		De 2 a 3 anos		De 3 a 4 anos		De 4 a 5 anos		Acima de 5 anos		Total	
	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%
<b>Dezembro/99</b>	0,91	3,79%	0,79	3,30%	0,43	1,80%	2,32	9,68%	0,21	0,87%	19,31	80,57%	23,97	100,00%
<b>Dezembro/00</b>	1,31	5,46%	0,82	3,41%	2,67	11,10%	0,22	0,91%	0,21	0,87%	18,83	78,24%	24,07	100,00%
<b>Dezembro/01</b>	0,97	4,14%	1,97	8,37%	0,25	1,04%	0,23	0,99%	0,15	0,62%	19,96	84,84%	23,52	100,00%
<b>Dezembro/02</b>	0,91	7,11%	0,48	3,74%	0,62	4,83%	0,16	1,29%	2,08	16,28%	8,53	66,75%	12,78	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	0,67	5,12%	1,29	9,86%	0,77	5,87%	2,75	21,04%	0,62	4,73%	6,99	53,38%	13,09	100,00%
<b>Junho/04</b>	0,76	5,53%	1,13	8,14%	0,61	4,39%	2,70	19,56%	0,76	5,49%	7,86	56,89%	13,82	100,00%
<b>Julho/04</b>	0,79	5,56%	1,16	8,18%	0,62	4,41%	2,73	19,33%	0,78	5,50%	8,06	57,03%	14,14	100,00%
<b>Agosto/04</b>	0,90	6,20%	1,20	8,34%	0,64	4,43%	2,75	19,02%	0,86	5,95%	8,10	56,07%	14,44	100,00%
<b>Setembro/04</b>	0,91	6,19%	1,23	8,37%	0,66	4,53%	2,78	18,99%	0,91	6,21%	8,16	55,71%	14,64	100,00%
<b>Outubro/04</b>	1,19	8,01%	0,76	5,09%	0,69	4,63%	2,81	18,96%	0,98	6,58%	8,42	56,73%	14,84	100,00%
<b>Novembro/04</b>	1,23	8,43%	0,75	5,12%	0,68	4,68%	2,82	19,32%	1,00	6,84%	8,13	55,62%	14,61	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	1,56	7,07%	1,08	4,92%	3,23	14,66%	0,93	4,23%	1,66	7,54%	13,57	61,58%	22,04	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	1,65	7,39%	1,09	4,90%	3,25	14,60%	1,00	4,50%	1,67	7,49%	13,61	61,11%	22,27	100,00%
<b>Fevereiro/05</b>	1,65	7,37%	1,10	4,90%	3,27	14,61%	1,07	4,79%	1,67	7,49%	13,60	60,84%	22,36	100,00%
<b>Março/05</b>	1,65	7,35%	1,11	4,94%	3,29	14,69%	1,15	5,11%	1,68	7,47%	13,55	60,44%	22,43	100,00%
<b>Abril/05</b>	1,58	7,14%	1,11	5,01%	3,31	14,98%	1,20	5,44%	1,66	7,49%	13,25	59,94%	22,10	100,00%
<b>Mai/05</b>	1,66	7,47%	1,12	5,01%	3,34	14,97%	1,34	6,00%	1,60	7,19%	13,23	59,37%	22,28	100,00%

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.

## ANEXO V

### **ESTRUTURA DE VENCIMENTOS DOS TÍTULOS FEDERAIS** **EM PODER DO PÚBLICO POR TIPO DE RENTABILIDADE**

#### **Outros**

Em R\$ bilhões

Mês	Até 1 ano		De 1 a 2 anos		De 2 a 3 anos		De 3 a 4 anos		De 4 a 5 anos		Acima de 5 anos		Total	
	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%	Saldo	%
<b>Dezembro/99</b>	0,02	3,34%	0,53	79,51%	0,01	0,94%	0,00	0,25%	0,00	0,01%	0,11	15,96%	0,67	100,00%
<b>Dezembro/00</b>	0,24	66,47%	0,02	6,72%	0,02	4,38%	0,00	0,01%	0,00	0,66%	0,08	21,77%	0,36	100,00%
<b>Dezembro/01</b>	0,02	23,62%	0,02	16,51%	0,00	0,03%	0,00	1,93%	0,06	57,92%	0,00	0,00%	0,10	100,00%
<b>Dezembro/02</b>	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,05	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,05	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	0,02	49,75%	0,01	37,56%	0,00	12,69%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,03	100,00%
<b>Junho/04</b>	0,02	57,67%	0,01	33,67%	0,00	8,67%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,03	100,00%
<b>Julho/04</b>	0,01	57,67%	0,01	33,67%	0,00	8,67%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,02	100,00%
<b>Agosto/04</b>	0,01	74,44%	0,00	25,56%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,02	100,00%
<b>Setembro/04</b>	0,01	74,44%	0,00	25,56%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,02	100,00%
<b>Outubro/04</b>	0,01	74,44%	0,00	25,56%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,02	100,00%
<b>Novembro/04</b>	0,01	74,44%	0,00	25,56%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,02	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	0,01	59,69%	0,01	40,31%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,02	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	0,01	79,64%	0,00	20,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	100,00%
<b>Fevereiro/05</b>	0,01	79,64%	0,00	20,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	100,00%
<b>Março/05</b>	0,01	79,64%	0,00	20,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	100,00%
<b>Abril/05</b>	0,01	79,64%	0,00	20,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	100,00%
<b>Mai/05</b>	0,01	79,64%	0,00	20,36%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	100,00%

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.