

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	%
Dezembro/99	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%
Dezembro/00	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%
Dezembro/01	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%
Dezembro/02	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%
Dezembro/03	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%
Dezembro/04	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%
Janeiro/05	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%
Fevereiro/05	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%
Março/05	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%
Abril/05	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%
Mai/05	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%
Junho/05	152,66	73,46%	48,68	23,42%	5,40	2,60%	0,07	0,04%	0,67	0,32%	0,33	0,16%	207,82	100,00%
Julho/05	144,18	70,39%	53,67	26,20%	5,24	2,56%	0,10	0,05%	0,90	0,44%	0,76	0,37%	204,84	100,00%
Agosto/05	145,00	65,97%	66,32	30,17%	6,57	2,99%	0,19	0,09%	1,01	0,46%	0,71	0,32%	219,79	100,00%
Setembro/05	145,97	60,72%	82,12	34,16%	9,54	3,97%	0,27	0,11%	1,41	0,59%	1,09	0,45%	240,39	100,00%
Outubro/05	143,91	62,72%	68,71	29,95%	13,60	5,93%	0,32	0,14%	1,68	0,73%	1,23	0,54%	229,44	100,00%
Novembro/05	147,70	57,27%	83,33	32,31%	23,18	8,99%	0,36	0,14%	2,00	0,78%	1,31	0,51%	257,88	100,00%
Dezembro/05	149,90	54,93%	92,88	34,03%	25,91	9,49%	0,41	0,15%	2,27	0,83%	1,52	0,56%	272,90	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	%
Dezembro/99	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%
Dezembro/00	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%
Dezembro/01	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%
Dezembro/02	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%
Dezembro/03	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%
Dezembro/04	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%
Janeiro/05	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%
Fevereiro/05	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%
Março/05	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%
Abril/05	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%
Mai/05	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%
Junho/05	221,14	42,75%	164,09	31,72%	101,60	19,64%	18,58	3,59%	2,99	0,58%	8,87	1,72%	517,28	100,00%
Julho/05	229,27	43,26%	154,68	29,18%	102,32	19,30%	25,56	4,82%	9,22	1,74%	8,96	1,69%	530,01	100,00%
Agosto/05	214,19	41,24%	146,69	28,24%	103,12	19,86%	31,53	6,07%	14,77	2,84%	9,05	1,74%	519,36	100,00%
Setembro/05	200,97	39,26%	164,96	32,23%	97,01	18,95%	37,33	7,29%	2,50	0,49%	9,13	1,78%	511,90	100,00%
Outubro/05	210,62	39,83%	156,28	29,56%	97,96	18,53%	46,88	8,87%	7,80	1,48%	9,21	1,74%	528,75	100,00%
Novembro/05	225,44	43,59%	126,20	24,40%	95,72	18,51%	52,79	10,21%	9,66	1,87%	7,43	1,44%	517,24	100,00%
Dezembro/05	227,47	44,85%	133,41	26,30%	93,35	18,41%	36,45	7,19%	8,99	1,77%	7,49	1,48%	507,16	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	%
Dezembro/99	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%
Dezembro/00	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%
Dezembro/01	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%
Dezembro/02	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%
Dezembro/03	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%
Dezembro/04	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%
Janeiro/05	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%
Fevereiro/05	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%
Março/05	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%
Abril/05	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%
Mai/05	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%
Junho/05	25,24	20,08%	14,30	11,37%	21,17	16,84%	9,96	7,92%	4,60	3,66%	50,45	40,13%	125,72	100,00%
Julho/05	19,80	15,79%	19,84	15,82%	21,34	17,02%	9,98	7,96%	4,57	3,64%	49,88	39,77%	125,41	100,00%
Agosto/05	23,04	18,26%	17,19	13,62%	21,39	16,95%	9,98	7,91%	4,60	3,64%	50,01	39,62%	126,23	100,00%
Setembro/05	23,03	18,10%	15,01	11,80%	24,42	19,19%	10,22	8,03%	4,61	3,62%	49,95	39,25%	127,24	100,00%
Outubro/05	23,10	17,79%	14,85	11,44%	24,66	19,00%	12,15	9,36%	4,67	3,60%	50,40	38,82%	129,83	100,00%
Novembro/05	23,19	16,72%	19,59	14,13%	26,03	18,77%	14,36	10,35%	4,71	3,40%	50,82	36,64%	138,70	100,00%
Dezembro/05	17,38	11,42%	22,10	14,52%	28,23	18,55%	27,72	18,21%	4,81	3,16%	51,94	34,13%	152,19	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	%
Dezembro/99	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%
Dezembro/00	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%
Dezembro/01	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%
Dezembro/02	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%
Dezembro/03	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%
Dezembro/04	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%
Janeiro/05	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%
Fevereiro/05	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%
Março/05	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%
Abril/05	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%
Mai/05	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%
Junho/05	9,10	28,29%	9,77	30,36%	1,16	3,60%	1,92	5,98%	0,78	2,43%	9,43	29,33%	32,16	100,00%
Julho/05	9,31	28,38%	10,01	30,50%	2,13	6,49%	0,95	2,90%	0,80	2,43%	9,62	29,31%	32,82	100,00%
Agosto/05	9,29	28,39%	10,00	30,56%	2,13	6,51%	0,95	2,91%	0,80	2,43%	9,56	29,21%	32,72	100,00%
Setembro/05	10,95	35,58%	7,16	23,29%	2,02	6,56%	0,90	2,92%	0,75	2,43%	8,99	29,22%	30,76	100,00%
Outubro/05	12,37	43,18%	3,96	13,82%	2,14	7,48%	0,96	3,34%	0,84	2,93%	8,38	29,25%	28,64	100,00%
Novembro/05	11,34	45,79%	1,32	5,35%	2,11	8,54%	0,94	3,80%	0,82	3,33%	8,22	33,19%	24,76	100,00%
Dezembro/05	12,13	45,94%	1,41	5,32%	2,26	8,54%	1,00	3,78%	0,88	3,32%	8,74	33,09%	26,41	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	%
Dezembro/99	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%
Dezembro/00	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%
Dezembro/01	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%
Dezembro/02	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%
Dezembro/03	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%
Dezembro/04	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%
Janeiro/05	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%
Fevereiro/05	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%
Março/05	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%
Abril/05	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%
Mai/05	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%
Junho/05	1,68	7,46%	1,15	5,09%	3,38	15,03%	1,43	6,34%	1,63	7,22%	13,25	58,86%	22,52	100,00%
Julho/05	1,69	7,50%	1,17	5,17%	3,42	15,13%	1,51	6,68%	1,63	7,21%	13,17	58,32%	22,59	100,00%
Agosto/05	1,71	7,52%	1,18	5,20%	3,44	15,18%	1,58	6,97%	1,63	7,17%	13,15	57,97%	22,69	100,00%
Setembro/05	1,91	8,35%	1,29	5,61%	3,55	15,50%	1,69	7,39%	1,63	7,11%	12,84	56,04%	22,92	100,00%
Outubro/05	1,09	5,27%	1,10	5,30%	3,40	16,43%	1,58	7,66%	1,48	7,17%	12,03	58,18%	20,67	100,00%
Novembro/05	0,98	4,66%	1,14	5,47%	3,45	16,51%	1,68	8,05%	1,52	7,25%	12,14	58,05%	20,92	100,00%
Dezembro/05	1,03	4,90%	3,57	16,98%	1,06	5,04%	1,76	8,36%	1,50	7,16%	12,09	57,55%	21,01	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.

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	%
Dezembro/99	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%
Dezembro/00	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%
Dezembro/01	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%
Dezembro/02	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%
Dezembro/03	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%
Dezembro/04	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%
Janeiro/05	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%
Fevereiro/05	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%
Março/05	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%
Abril/05	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%
Mai/05	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%
Junho/05	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%
Julho/05	0,00	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	100,00%
Agosto/05	0,00	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	100,00%
Setembro/05	0,00	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	100,00%
Outubro/05	0,00	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	100,00%
Novembro/05	0,01	100,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	100,00%
Dezembro/05	0,01	100,00%	0,00	0,00%	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.