

## ANEXO VI

### SÉRIES HISTÓRICAS

#### ***C - Composição da DPMFi em Poder do Público por Tipo de Rentabilidade (por exposição - após swap)***

Em R\$ bilhões														
Mês	Prefixados		Taxa SELIC		Índice de preços		Câmbio		TR		Outros		Total	
Dezembro/99	39,75	9,00%	251,68	57,02%	24,63	5,58%	100,71	22,82%	23,97	5,43%	0,67	0,15%	441,41	100,00%
Janeiro/00	42,80	9,45%	257,07	56,73%	24,73	5,46%	102,05	22,52%	25,69	5,67%	0,78	0,17%	453,13	100,00%
Fevereiro/00	47,29	10,35%	258,75	56,64%	25,64	5,61%	98,57	21,57%	25,86	5,66%	0,76	0,17%	456,86	100,00%
Março/00	56,68	12,21%	256,92	55,34%	25,79	5,56%	98,16	21,14%	25,96	5,59%	0,73	0,16%	464,25	100,00%
Abril/00	64,68	13,68%	253,50	53,60%	26,21	5,54%	101,51	21,46%	26,34	5,57%	0,71	0,15%	472,95	100,00%
Mai/00	61,27	12,58%	267,32	54,88%	26,72	5,48%	104,56	21,47%	26,56	5,45%	0,68	0,14%	487,10	100,00%
Junho/00	65,44	13,31%	268,90	54,68%	26,72	5,43%	103,65	21,08%	26,44	5,38%	0,66	0,13%	491,81	100,00%
Julho/00	68,62	13,86%	269,09	54,34%	27,77	5,61%	102,75	20,75%	26,38	5,33%	0,61	0,12%	495,22	100,00%
Agosto/00	72,56	14,69%	262,57	53,15%	28,50	5,77%	104,92	21,24%	24,87	5,03%	0,58	0,12%	494,00	100,00%
Setembro/00	77,43	15,40%	264,76	52,67%	28,93	5,76%	106,01	21,09%	24,97	4,97%	0,55	0,11%	502,65	100,00%
Outubro/00	79,59	15,70%	263,54	51,98%	29,59	5,84%	109,87	21,67%	24,00	4,73%	0,42	0,08%	507,00	100,00%
Novembro/00	74,54	14,70%	264,38	52,15%	29,85	5,89%	113,77	22,44%	24,01	4,74%	0,39	0,08%	506,93	100,00%
Dezembro/00	75,40	14,76%	266,81	52,24%	30,32	5,94%	113,74	22,27%	24,07	4,71%	0,36	0,07%	510,70	100,00%
Janeiro/01	74,08	14,44%	263,50	51,37%	35,50	6,92%	115,34	22,49%	24,18	4,71%	0,31	0,06%	512,92	100,00%
Fevereiro/01	71,88	13,86%	265,20	51,12%	37,52	7,23%	119,72	23,08%	24,18	4,66%	0,28	0,05%	518,79	100,00%
Março/01	75,47	14,07%	268,99	50,14%	38,32	7,14%	129,11	24,07%	24,34	4,54%	0,25	0,05%	536,48	100,00%
Abril/01	68,00	12,39%	278,49	50,76%	38,94	7,10%	135,97	24,78%	26,98	4,92%	0,21	0,04%	548,59	100,00%
Mai/01	63,17	11,39%	274,09	49,42%	40,94	7,38%	149,10	26,89%	27,09	4,88%	0,18	0,03%	554,56	100,00%
Junho/01	62,90	10,83%	291,79	50,24%	41,54	7,15%	155,66	26,80%	28,75	4,95%	0,18	0,03%	580,83	100,00%
Julho/01	60,66	10,16%	307,78	51,53%	40,01	6,70%	165,80	27,76%	22,86	3,83%	0,17	0,03%	597,28	100,00%
Agosto/01	58,13	9,59%	309,23	51,01%	41,31	6,82%	174,74	28,83%	22,59	3,73%	0,17	0,03%	606,18	100,00%
Setembro/01	57,20	9,09%	310,20	49,31%	41,78	6,64%	197,33	31,37%	22,40	3,56%	0,17	0,03%	629,09	100,00%
Outubro/01	52,90	8,30%	310,65	48,76%	42,70	6,70%	209,29	32,85%	21,44	3,37%	0,10	0,02%	637,08	100,00%
Novembro/01	51,19	8,17%	315,62	50,34%	43,68	6,97%	194,82	31,07%	21,52	3,43%	0,10	0,02%	626,93	100,00%
Dezembro/01	48,79	7,82%	329,46	52,79%	43,63	6,99%	178,58	28,61%	23,52	3,77%	0,10	0,02%	624,08	100,00%
Janeiro/02	48,06	7,57%	334,10	52,61%	51,41	8,10%	186,45	29,36%	14,94	2,35%	0,14	0,02%	635,11	100,00%
Fevereiro/02	47,38	7,50%	333,01	52,72%	54,14	8,57%	181,30	28,70%	15,60	2,47%	0,21	0,03%	631,64	100,00%
Março/02	56,83	9,07%	320,47	51,17%	54,13	8,64%	179,60	28,68%	15,08	2,41%	0,21	0,03%	626,32	100,00%
Abril/02	61,90	9,77%	317,09	50,07%	56,34	8,90%	182,64	28,84%	15,11	2,39%	0,21	0,03%	633,29	100,00%
Mai/02	60,99	9,54%	312,80	48,92%	57,06	8,92%	193,70	30,29%	14,64	2,29%	0,21	0,03%	639,39	100,00%
Junho/02	56,19	8,60%	307,72	47,07%	58,24	8,91%	216,74	33,15%	14,64	2,24%	0,21	0,03%	653,75	100,00%
Julho/02	51,74	7,67%	299,79	44,45%	60,51	8,97%	249,84	37,05%	12,31	1,83%	0,21	0,03%	674,40	100,00%
Agosto/02	48,17	7,73%	282,62	45,38%	61,47	9,87%	217,87	34,98%	12,42	1,99%	0,24	0,04%	622,79	100,00%
Setembro/02	43,03	6,53%	271,88	41,27%	63,12	9,58%	267,92	40,67%	12,57	1,91%	0,26	0,04%	658,78	100,00%
Outubro/02	41,05	6,49%	270,95	42,86%	67,50	10,68%	240,02	37,97%	12,48	1,97%	0,10	0,02%	632,10	100,00%
Novembro/02	27,87	4,41%	275,57	43,64%	77,41	12,26%	237,94	37,68%	12,56	1,99%	0,10	0,02%	631,46	100,00%

## ANEXO VI

### SÉRIES HISTÓRICAS

#### ***C - Composição da DPMFi em Poder do Público por Tipo de Rentabilidade (por exposição - após swap)***

Em R\$ bilhões														
Mês	Prefixados		Taxa SELIC		Índice de preços		Câmbio		TR		Outros		Total	
<b>Dezembro/02</b>	13,66	2,19%	287,97	46,21%	78,17	12,54%	230,57	37,00%	12,78	2,05%	0,05	0,01%	623,19	100,00%
<b>Janeiro/03</b>	12,17	1,91%	300,81	47,23%	79,40	12,47%	231,60	36,37%	12,85	2,02%	0,04	0,01%	636,86	100,00%
<b>Fevereiro/03</b>	12,80	1,98%	300,05	46,53%	82,22	12,75%	236,85	36,73%	12,92	2,00%	0,04	0,01%	644,88	100,00%
<b>Março/03</b>	15,68	2,41%	311,46	47,94%	84,10	12,95%	225,44	34,70%	12,99	2,00%	0,04	0,01%	649,70	100,00%
<b>Abril/03</b>	12,32	1,91%	337,74	52,41%	85,55	13,28%	195,66	30,36%	13,10	2,03%	0,04	0,01%	644,41	100,00%
<b>Mai/03</b>	21,59	3,27%	336,85	50,98%	86,40	13,08%	202,58	30,66%	13,30	2,01%	0,04	0,01%	660,76	100,00%
<b>Junho/03</b>	29,99	4,48%	345,59	51,63%	85,87	12,83%	194,49	29,05%	13,45	2,01%	0,03	0,00%	669,42	100,00%
<b>Julho/03</b>	43,52	6,31%	351,33	50,92%	85,32	12,37%	196,23	28,44%	13,56	1,97%	0,03	0,00%	689,99	100,00%
<b>Agosto/03</b>	51,63	7,42%	350,31	50,34%	86,29	12,40%	194,80	27,99%	12,89	1,85%	0,03	0,00%	695,95	100,00%
<b>Setembro/03</b>	64,02	9,05%	353,87	50,00%	90,24	12,75%	186,62	26,37%	12,96	1,83%	0,03	0,00%	707,74	100,00%
<b>Outubro/03</b>	70,97	9,89%	366,67	51,08%	93,24	12,99%	174,27	24,28%	12,67	1,76%	0,03	0,00%	717,86	100,00%
<b>Novembro/03</b>	82,08	11,27%	365,52	50,19%	94,28	12,95%	173,52	23,82%	12,88	1,77%	0,03	0,00%	728,31	100,00%
<b>Dezembro/03</b>	91,53	12,51%	366,31	50,08%	99,07	13,55%	161,39	22,06%	13,09	1,79%	0,03	0,00%	731,43	100,00%
<b>Janeiro/04</b>	92,71	12,57%	376,39	51,05%	99,89	13,55%	155,07	21,03%	13,26	1,80%	0,02	0,00%	737,34	100,00%
<b>Fevereiro/04</b>	100,97	13,59%	385,18	51,83%	102,27	13,76%	141,36	19,02%	13,35	1,80%	0,03	0,00%	743,15	100,00%
<b>Março/04</b>	117,06	15,41%	391,36	51,51%	103,38	13,61%	134,54	17,71%	13,47	1,77%	0,03	0,00%	759,84	100,00%
<b>Abril/04</b>	121,25	15,79%	400,92	52,23%	106,74	13,90%	125,22	16,31%	13,51	1,76%	0,03	0,00%	767,67	100,00%
<b>Mai/04</b>	122,52	16,37%	378,47	50,57%	109,63	14,65%	124,09	16,58%	13,64	1,82%	0,03	0,00%	748,38	100,00%
<b>Junho/04</b>	127,55	16,82%	383,81	50,62%	113,29	14,94%	119,70	15,79%	13,82	1,82%	0,03	0,00%	758,19	100,00%
<b>Julho/04</b>	114,90	15,13%	408,24	53,77%	114,75	15,12%	107,15	14,11%	14,14	1,86%	0,02	0,00%	759,20	100,00%
<b>Agosto/04</b>	126,87	16,66%	403,21	52,93%	117,04	15,36%	100,18	13,15%	14,44	1,90%	0,02	0,00%	761,77	100,00%
<b>Setembro/04</b>	134,68	17,46%	408,80	53,00%	118,14	15,32%	95,03	12,32%	14,64	1,90%	0,02	0,00%	771,30	100,00%
<b>Outubro/04</b>	135,16	17,41%	420,47	54,15%	118,75	15,29%	87,26	11,24%	14,84	1,91%	0,02	0,00%	776,50	100,00%
<b>Novembro/04</b>	146,84	18,71%	422,45	53,82%	119,80	15,26%	81,21	10,35%	14,61	1,86%	0,02	0,00%	784,94	100,00%
<b>Dezembro/04</b>	162,76	20,09%	424,68	52,41%	120,71	14,90%	80,05	9,88%	22,04	2,72%	0,02	0,00%	810,26	100,00%
<b>Janeiro/05</b>	154,67	18,71%	462,95	56,00%	120,38	14,56%	66,42	8,03%	22,27	2,69%	0,01	0,00%	826,70	100,00%

Obs.: Valores apurados com base na posição de carteira avaliada pelo preço da curva de rentabilidade intrínseca dos títulos.

Retirou-se o valor de referência para ajuste do swap do estoque de títulos atualizados pela taxa Selic, incorporando-se-o ao estoque de cambiais.