

ANEXO VI

SÉRIES HISTÓRICAS

D - Exposição por tipo de rentabilidade da DPMFi somada às operações de mercado aberto

Em R\$ bilhões

Mês	Prefixados		Taxa SELIC		Índice de preços		Câmbio		TR		Outros		Oper. de mercado aberto (c)				Total	
													Até 1 mês	+ de 1 mês	% Até 1 mês	% + de 1 mês		
Dezembro/99	39,75	9,06%	251,68	57,36%	24,63	5,61%	100,71	22,95%	23,97	5,46%	0,67	0,15%	(2,60)	-	-0,59%	0,00%	438,80	100,00%
Janeiro/00	42,80	9,31%	257,07	55,94%	24,73	5,38%	102,05	22,21%	25,69	5,59%	0,78	0,17%	6,43	-	1,40%	0,00%	459,56	100,00%
Fevereiro/00	47,29	10,27%	258,75	56,17%	25,64	5,57%	98,57	21,40%	25,86	5,61%	0,76	0,16%	3,78	-	0,82%	0,00%	460,64	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%	-	-	0,00%	0,00%	464,25	100,00%
Abril/00	64,68	13,77%	253,50	53,97%	26,21	5,58%	101,51	21,61%	26,34	5,61%	0,71	0,15%	(3,26)	-	-0,69%	0,00%	469,69	100,00%
Mai/00	61,27	12,50%	267,32	54,54%	26,72	5,45%	104,56	21,33%	26,56	5,42%	0,68	0,14%	2,99	-	0,61%	0,00%	490,09	100,00%
Junho/00	65,44	13,19%	268,90	54,20%	26,72	5,39%	103,65	20,89%	26,44	5,33%	0,66	0,13%	4,28	-	0,86%	0,00%	496,10	100,00%
Julho/00	68,62	13,78%	269,09	54,05%	27,77	5,58%	102,75	20,64%	26,38	5,30%	0,61	0,12%	1,47	1,21	0,29%	0,24%	497,89	100,00%
Agosto/00	72,56	14,59%	262,57	52,78%	28,50	5,73%	104,92	21,09%	24,87	5,00%	0,58	0,12%	-	3,46	0,00%	0,70%	497,47	100,00%
Setembro/00	77,43	15,39%	264,76	52,62%	28,93	5,75%	106,01	21,07%	24,97	4,96%	0,55	0,11%	(3,03)	3,51	-0,60%	0,70%	503,12	100,00%
Outubro/00	79,59	15,58%	263,54	51,60%	29,59	5,79%	109,87	21,51%	24,00	4,70%	0,42	0,08%	-	3,75	0,00%	0,73%	510,75	100,00%
Novembro/00	74,54	14,59%	264,38	51,76%	29,85	5,84%	113,77	22,27%	24,01	4,70%	0,39	0,08%	-	3,83	0,00%	0,75%	510,76	100,00%
Dezembro/00	75,40	14,88%	266,81	52,66%	30,32	5,98%	113,74	22,45%	24,07	4,75%	0,36	0,07%	(7,86)	3,87	-1,55%	0,76%	506,71	100,00%
Janeiro/01	74,08	14,14%	263,50	50,28%	35,50	6,77%	115,34	22,01%	24,18	4,61%	0,31	0,06%	7,22	3,94	1,38%	0,75%	524,08	100,00%
Fevereiro/01	71,88	13,73%	265,20	50,64%	37,52	7,16%	119,72	22,86%	24,18	4,62%	0,28	0,05%	1,03	3,88	0,20%	0,74%	523,70	100,00%
Março/01	75,47	14,01%	268,99	49,92%	38,32	7,11%	129,11	23,96%	24,34	4,52%	0,25	0,05%	(1,57)	3,93	-0,29%	0,73%	538,84	100,00%
Abril/01	68,00	12,47%	278,49	51,06%	38,94	7,14%	135,97	24,93%	26,98	4,95%	0,21	0,04%	(5,55)	2,33	-1,02%	0,43%	545,37	100,00%
Mai/01	63,17	11,39%	274,09	49,41%	40,94	7,38%	149,10	26,88%	27,09	4,88%	0,18	0,03%	(2,14)	2,36	-0,39%	0,43%	554,77	100,00%
Junho/01	62,90	10,99%	291,79	50,98%	41,54	7,26%	155,66	27,19%	28,75	5,02%	0,18	0,03%	(10,24)	1,81	-1,79%	0,32%	572,39	100,00%
Julho/01	60,66	10,10%	307,78	51,26%	40,01	6,66%	165,80	27,61%	22,86	3,81%	0,17	0,03%	2,81	0,39	0,47%	0,06%	600,48	100,00%
Agosto/01	58,13	9,58%	309,23	50,99%	41,31	6,81%	174,74	28,81%	22,59	3,72%	0,17	0,03%	-	0,34	0,00%	0,06%	606,51	100,00%
Setembro/01	57,20	9,35%	310,20	50,71%	41,78	6,83%	197,33	32,26%	22,40	3,66%	0,17	0,03%	(17,75)	0,34	-2,90%	0,06%	611,68	100,00%
Outubro/01	52,90	8,54%	310,65	50,17%	42,70	6,90%	209,29	33,80%	21,44	3,46%	0,10	0,02%	(18,29)	0,35	-2,95%	0,06%	619,13	100,00%
Novembro/01	51,19	8,46%	315,62	52,19%	43,68	7,22%	194,82	32,21%	21,52	3,56%	0,10	0,02%	(22,51)	0,35	-3,72%	0,06%	604,77	100,00%
Dezembro/01	48,79	8,06%	329,46	54,42%	43,63	7,21%	178,58	29,50%	23,52	3,89%	0,10	0,02%	(19,01)	0,36	-3,14%	0,06%	605,43	100,00%
Janeiro/02	48,06	7,69%	334,10	53,45%	51,41	8,23%	186,45	29,83%	14,94	2,39%	0,14	0,02%	(10,40)	0,36	-1,66%	0,06%	625,07	100,00%
Fevereiro/02	47,38	7,57%	333,01	53,18%	54,14	8,65%	181,30	28,95%	15,60	2,49%	0,21	0,03%	(5,96)	0,49	-0,95%	0,08%	626,16	100,00%
Março/02	56,83	9,05%	320,47	51,01%	54,13	8,62%	179,60	28,59%	15,08	2,40%	0,21	0,03%	1,40	0,49	0,22%	0,08%	628,21	100,00%
Abril/02	61,90	9,69%	317,09	49,65%	56,34	8,82%	182,64	28,60%	15,11	2,37%	0,21	0,03%	4,81	0,50	0,75%	0,08%	638,59	100,00%
Mai/02	60,99	9,41%	312,80	48,25%	57,06	8,80%	193,70	29,88%	14,64	2,26%	0,21	0,03%	2,23	6,64	0,34%	1,02%	648,26	100,00%
Junho/02	56,19	8,33%	307,72	45,61%	58,24	8,63%	216,74	32,12%	14,64	2,17%	0,21	0,03%	14,08	6,93	2,09%	1,03%	674,76	100,00%
Julho/02	51,74	7,40%	299,79	42,89%	60,51	8,66%	249,84	35,74%	12,31	1,76%	0,21	0,03%	19,75	4,90	2,83%	0,70%	699,05	100,00%
Agosto/02	48,17	7,23%	282,62	42,45%	61,47	9,23%	217,87	32,72%	12,42	1,86%	0,24	0,04%	29,88	13,12	4,49%	1,97%	665,79	100,00%
Setembro/02	43,03	6,07%	271,88	38,33%	63,12	8,90%	267,92	37,77%	12,57	1,77%	0,26	0,04%	33,74	16,88	4,76%	2,38%	709,39	100,00%
Outubro/02	41,05	5,98%	270,95	39,45%	67,50	9,83%	240,02	34,95%	12,48	1,82%	0,10	0,02%	35,95	18,74	5,23%	2,73%	686,79	100,00%
Novembro/02	27,87	4,02%	275,57	39,76%	77,41	11,17%	237,94	34,33%	12,56	1,81%	0,10	0,01%	49,62	11,99	7,16%	1,73%	693,07	100,00%
Dezembro/02	13,66	1,99%	287,97	41,90%	78,17	11,37%	230,57	33,55%	12,78	1,86%	0,05	0,01%	64,00	0,11	9,31%	0,02%	687,30	100,00%
Janeiro/03	12,17	1,70%	300,81	41,92%	79,40	11,06%	231,60	32,28%	12,85	1,79%	0,04	0,01%	80,70	-	11,25%	0,00%	717,57	100,00%
Fevereiro/03	12,80	1,78%	300,05	41,63%	82,22	11,41%	236,85	32,86%	12,92	1,79%	0,04	0,01%	75,83	-	10,52%	0,00%	720,71	100,00%

ANEXO VI

SÉRIES HISTÓRICAS

D - Exposição por tipo de rentabilidade da DPMFi somada às operações de mercado aberto

Em R\$ bilhões

Mês	Prefixados		Taxa SELIC		Índice de preços		Câmbio		TR		Outros		Oper. de mercado aberto (c)				Total	
													Até 1 mês	+ de 1 mês	% Até 1 mês	% + de 1 mês		
Março/03	15,68	2,17%	311,46	43,18%	84,10	11,66%	225,44	31,25%	12,99	1,80%	0,04	0,01%	71,64	-	9,93%	0,00%	721,34	100,00%
Abril/03	12,32	1,77%	337,74	48,49%	85,55	12,28%	195,66	28,09%	13,10	1,88%	0,04	0,01%	52,14	-	7,49%	0,00%	696,54	100,00%
Mai/03	21,59	3,04%	336,85	47,48%	86,40	12,18%	202,58	28,56%	13,30	1,88%	0,04	0,01%	48,65	-	6,86%	0,00%	709,40	100,00%
Junho/03	29,99	4,18%	345,59	48,15%	85,87	11,96%	194,49	27,10%	13,45	1,87%	0,03	0,00%	48,39	-	6,74%	0,00%	717,81	100,00%
Julho/03	43,52	5,92%	351,33	47,78%	85,32	11,60%	196,23	26,68%	13,56	1,84%	0,03	0,00%	45,38	-	6,17%	0,00%	735,37	100,00%
Agosto/03	51,63	6,85%	350,31	46,49%	86,29	11,45%	194,80	25,85%	12,89	1,71%	0,03	0,00%	57,57	-	7,64%	0,00%	753,52	100,00%
Setembro/03	64,02	8,35%	353,87	46,16%	90,24	11,77%	186,62	24,34%	12,96	1,69%	0,03	0,00%	58,93	-	7,69%	0,00%	766,67	100,00%
Outubro/03	70,97	9,19%	366,67	47,46%	93,24	12,07%	174,27	22,56%	12,67	1,64%	0,03	0,00%	54,74	-	7,09%	0,00%	772,60	100,00%
Novembro/03	82,08	10,54%	365,52	46,94%	94,28	12,11%	173,52	22,28%	12,88	1,65%	0,03	0,00%	50,45	4,66	6,48%	0,60%	783,41	100,00%
Dezembro/03	91,53	11,63%	366,31	46,54%	99,07	12,59%	161,39	20,50%	13,09	1,66%	0,03	0,00%	43,74	11,97	5,56%	1,52%	787,14	100,00%
Janeiro/04	92,71	11,40%	376,39	46,27%	99,89	12,28%	155,07	19,06%	13,26	1,63%	0,02	0,00%	57,99	18,18	7,13%	2,23%	813,51	100,00%
Fevereiro/04	100,97	12,38%	385,18	47,22%	102,27	12,54%	141,36	17,33%	13,35	1,64%	0,03	0,00%	56,18	16,30	6,89%	2,00%	815,63	100,00%
Março/04	117,06	14,17%	391,36	47,38%	103,38	12,52%	134,54	16,29%	13,47	1,63%	0,03	0,00%	47,72	18,44	5,78%	2,23%	826,00	100,00%
Abril/04	121,25	14,68%	400,92	48,55%	106,74	12,93%	125,22	15,16%	13,51	1,64%	0,03	0,00%	39,01	19,17	4,72%	2,32%	825,86	100,00%
Mai/04	122,52	14,70%	378,47	45,40%	109,63	13,15%	124,09	14,88%	13,64	1,64%	0,03	0,00%	62,88	22,47	7,54%	2,69%	833,73	100,00%
Junho/04	127,55	15,23%	383,81	45,84%	113,29	13,53%	119,70	14,30%	13,82	1,65%	0,03	0,00%	46,51	32,58	5,55%	3,89%	837,27	100,00%
Julho/04	114,90	13,70%	408,24	48,67%	114,75	13,68%	107,15	12,77%	14,14	1,69%	0,02	0,00%	32,75	46,84	3,90%	5,58%	838,79	100,00%
Agosto/04	126,87	15,08%	403,21	47,94%	117,04	13,91%	100,18	11,91%	14,44	1,72%	0,02	0,00%	29,48	49,86	3,51%	5,93%	841,11	100,00%
Setembro/04	134,68	15,93%	408,80	48,36%	118,14	13,97%	95,03	11,24%	14,64	1,73%	0,02	0,00%	34,84	39,25	4,12%	4,64%	845,39	100,00%
Outubro/04	135,16	15,90%	420,47	49,46%	118,75	13,97%	87,26	10,26%	14,84	1,75%	0,02	0,00%	35,38	38,22	4,16%	4,50%	850,11	100,00%
Novembro/04	146,84	17,24%	422,45	49,58%	119,80	14,06%	81,21	9,53%	14,61	1,71%	0,02	0,00%	26,14	40,91	3,07%	4,80%	851,99	100,00%
Dezembro/04	162,76	18,98%	424,68	49,53%	120,71	14,08%	80,05	9,34%	22,04	2,57%	0,02	0,00%	7,80	39,41	0,91%	4,60%	857,47	100,00%
Janeiro/05	154,67	17,51%	462,95	52,40%	120,38	13,63%	66,42	7,52%	22,27	2,52%	0,01	0,00%	14,68	42,14	1,66%	4,77%	883,52	100,00%
Fevereiro/05	172,75	19,18%	478,47	53,14%	120,90	13,43%	50,90	5,65%	22,36	2,48%	0,01	0,00%	18,22	36,83	2,02%	4,09%	900,45	100,00%
Março/05	188,02	20,45%	497,81	54,15%	122,23	13,29%	43,12	4,69%	22,43	2,44%	0,01	0,00%	5,24	40,53	0,57%	4,41%	919,38	100,00%
Abril/05	176,96	19,26%	511,18	55,64%	123,22	13,41%	40,36	4,39%	22,10	2,41%	0,01	0,00%	3,77	41,20	0,41%	4,48%	918,80	100,00%
Mai/05	195,82	21,18%	508,25	54,97%	123,63	13,37%	37,94	4,10%	22,28	2,41%	0,01	0,00%	(3,70)	40,42	-0,40%	4,37%	924,65	100,00%
Junho/05	207,82	22,14%	512,17	54,56%	125,72	13,39%	37,28	3,97%	22,52	2,40%	0,01	0,00%	4,10	29,16	0,44%	3,11%	938,77	100,00%
Julho/05	204,84	21,54%	524,84	55,18%	125,41	13,18%	37,99	3,99%	22,59	2,37%	0,00	0,00%	(6,31)	41,84	-0,66%	4,40%	951,20	100,00%
Agosto/05	219,79	22,79%	514,22	53,31%	126,23	13,09%	37,87	3,93%	22,69	2,35%	0,00	0,00%	(2,32)	46,07	-0,24%	4,78%	964,55	100,00%
Setembro/05	240,39	24,66%	507,06	52,01%	127,24	13,05%	35,61	3,65%	22,92	2,35%	0,00	0,00%	(6,86)	48,59	-0,70%	4,98%	974,95	100,00%
Outubro/05	229,44	23,18%	521,93	52,74%	129,83	13,12%	35,46	3,58%	20,67	2,09%	0,00	0,00%	4,28	48,00	0,43%	4,85%	989,62	100,00%
Novembro/05	257,88	25,86%	510,55	51,20%	138,70	13,91%	31,45	3,15%	20,92	2,10%	0,01	0,00%	(11,57)	49,24	-1,16%	4,94%	997,18	100,00%

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

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

(c) As operações de mercado aberto referem-se ao saldo, corrigido pela taxa contratada, das operações de financiamento com prazo a decorrer no último dia útil do mês; valores positivos indicam financiamento tomado pelo Banco Central. São apresentadas as operações com prazo de contratação inferior e superior a 1 mês.