ANEXO XXI

CAPITAL DE RISCO BASEADO NO RISCO DE MERCADO - GERAL

Art. 1º O capital de risco de mercado é calculado de acordo com a seguinte fórmula:

$$CR_{merc.geral} = \sqrt{E' \times F \times E}$$

§1º Consideram-se, para efeitos deste anexo, os conceitos abaixo:

a) F: matriz de fatores de risco de mercado apresentados nas tabelas 1 a 9 deste anexo:

Tabela 1 – Matriz de Fatores de Risco

A	**B**	**C**	**D**
E	**F**	**G**	**H**

Tabela 2 – Matriz de Fatores de Risco – Partição A

	pre.21	pre.63	pre.126	pre.252	pre.378	pre.504	pre.630	pre.756	pre.1008	pre.1260	pre.2520	pre.3780	igpm.63	igpm.126	igpm.252	igpm.378	igpm.504	igpm.630	igpm.756	igpm.1008
pre.21	0.0000006	0.0000019	0.0000038	0.0000065	0.0000082	0.0000093	0.0000102	0.0000110	0.0000123	0.0000135	0.0000226	0.0000340	0.0000040	0.0000071	0.0000109	0.0000128	0.0000137	0.0000143	0.0000152	0.0000169
pre.63	0.0000019	0.0000069	0.0000153	0.0000308	0.0000419	0.0000502	0.0000571	0.0000638	0.0000747	0.0000840	0.0001315	0.0001797	0.0000128	0.0000230	0.0000379	0.0000479	0.0000550	0.0000603	0.0000665	0.0000765
pre.126	0.0000038	0.0000153	0.0000390	0.0000904	0.0001326	0.0001664	0.0001951	0.0002235	0.0002706	0.0003108	0.0004912	0.0006539	0.0000167	0.0000386	0.0000808	0.0001162	0.0001446	0.0001665	0.0001892	0.0002233
pre.252	0.0000065	0.0000308	0.0000904	0.0002469	0.0003970	0.0005272	0.0006417	0.0007544	0.0009438	0.0011054	0.0017917	0.0023669	-0.0000396	-0.0000037	0.0001129	0.0002368	0.0003442	0.0004274	0.0005055	0.0006179
pre.378	0.0000082	0.0000419	0.0001326	0.0003970	0.0006754	0.0009306	0.0011611	0.0013885	0.0017741	0.0021029	0.0034778	0.0046077	-0.0001615	-0.0001318	0.0000563	0.0002874	0.0004946	0.0006565	0.0008019	0.0010095
pre.504	0.0000093	0.0000502	0.0001664	0.0005272	0.0009306	0.0013151	0.0016698	0.0020217	0.0026235	0.0031365	0.0052558	0.0069780	-0.0003050	-0.0002933	-0.0000410	0.0002992	0.0006100	0.0008543	0.0010698	0.0013777
pre.630	0.0000102	0.0000571	0.0001951	0.0006417	0.0011611	0.0016698	0.0021472	0.0026236	0.0034447	0.0041454	0.0070107	0.0093188	-0.0004461	-0.0004560	-0.0001438	0.0003031	0.0007160	0.0010420	0.0013272	0.0017363
pre.756	0.0000110	0.0000638	0.0002235	0.0007544	0.0013885	0.0020217	0.0026236	0.0032278	0.0042766	0.0051736	0.0088188	0.0117384	-0.0005833	-0.0006155	-0.0002416	0.0003150	0.0008328	0.0012430	0.0016004	0.0021154
pre.1008	0.0000123	0.0000747	0.0002706	0.0009438	0.0017741	0.0026235	0.0034447	0.0042766	0.0057383	0.0069984	0.0121312	0.0162446	-0.0008115	-0.0008852	-0.0004021	0.0003498	0.0010542	0.0016143	0.0021014	0.0028080
pre.1260	0.0000135	0.0000840	0.0003108	0.0011054	0.0021029	0.0031365	0.0041454	0.0051736	0.0069984	0.0085887	0.0151900	0.0205649	-0.0009934	-0.0011034	-0.0005269	0.0003920	0.0012557	0.0019433	0.0025412	0.0034134
pre.2520	0.0000226	0.0001315	0.0004912	0.0017917	0.0034778	0.0052558	0.0070107	0.0088188	0.0121312	0.0151900	0.0300198	0.0438555	-0.0016526	-0.0019166	-0.0010177	0.0005082	0.0019445	0.0030867	0.0040801	0.0055668
pre.3780	0.0000340	0.0001797	0.0006539	0.0023669	0.0046077	0.0069780	0.0093188	0.0117384	0.0162446	0.0205649	0.0438555	0.0675445	-0.0021381	-0.0025307	-0.0014497	0.0004808	0.0022992	0.0037442	0.0050011	0.0069196
igpm.63	0.0000040	0.0000128	0.0000167	-0.0000396	-0.0001615	-0.0003050	-0.0004461	-0.0005833	-0.0008115	-0.0009934	-0.0016526	-0.0021381	0.0008711	0.0010165	0.0009823	0.0008427	0.0007039	0.0005884	0.0005146	0.0004041
igpm.126	0.0000071	0.0000230	0.0000386	-0.0000037	-0.0001318	-0.0002933	-0.0004560	-0.0006155	-0.0008852	-0.0011034	-0.0019166	-0.0025307	0.0010165	0.0013151	0.0013718	0.0012219	0.0010583	0.0009225	0.0008469	0.0007430
igpm.252	0.0000109	0.0000379	0.0000808	0.0001129	0.0000563	-0.0000410	-0.0001438	-0.0002416	-0.0004021	-0.0005269	-0.0010177	-0.0014497	0.0009823	0.0013718	0.0016562	0.0016558	0.0015733	0.0014787	0.0014441	0.0013939
igpm.378	0.0000128	0.0000479	0.0001162	0.0002368	0.0002874	0.0002992	0.0003031	0.0003150	0.0003498	0.0003920	0.0005082	0.0004808	0.0008427	0.0012219	0.0016558	0.0018415	0.0019053	0.0019096	0.0019544	0.0020000
igpm.504	0.0000137	0.0000550	0.0001446	0.0003442	0.0004946	0.0006100	0.0007160	0.0008328	0.0010542	0.0012557	0.0019445	0.0022992	0.0007039	0.0010583	0.0015733	0.0019053	0.0021100	0.0022249	0.0023618	0.0025272
igpm.630	0.0000143	0.0000603	0.0001665	0.0004274	0.0006565	0.0008543	0.0010420	0.0012430	0.0016143	0.0019433	0.0030867	0.0037442	0.0005884	0.0009225	0.0014787	0.0019096	0.0022249	0.0024364	0.0026581	0.0029424
igpm.756	0.0000152	0.0000665	0.0001892	0.0005055	0.0008019	0.0010698	0.0013272	0.0016004	0.0021014	0.0025412	0.0040801	0.0050011	0.0005146	0.0008469	0.0014441	0.0019544	0.0023618	0.0026581	0.0029590	0.0033607
igpm.1008	0.0000169	0.0000765	0.0002233	0.0006179	0.0010095	0.0013777	0.0017363	0.0021154	0.0028080	0.0034134	0.0055668	0.0069196	0.0004041	0.0007430	0.0013939	0.0020000	0.0025272	0.0029424	0.0033607	0.0039511
igpm.1260	0.0000196	0.0000884	0.0002599	0.0007286	0.0012070	0.0016662	0.0021171	0.0025937	0.0034655	0.0042295	0.0070116	0.0088365	0.0003412	0.0007077	0.0014294	0.0021212	0.0027447	0.0032541	0.0037697	0.0045252
igpm.2520	0.0000401	0.0001706	0.0004936	0.0014049	0.0024001	0.0033979	0.0043913	0.0054398	0.0073712	0.0090979	0.0160615	0.0213275	0.0001392	0.0006832	0.0018795	0.0030923	0.0042095	0.0051393	0.0060789	0.0075640
igpm.3780	0.0000591	0.0002488	0.0007163	0.0020497	0.0035418	0.0050517	0.0065508	0.0081251	0.0110192	0.0136225	0.0245250	0.0331552	-0.0000607	0.0005716	0.0021570	0.0038733	0.0054489	0.0067316	0.0079947	0.0099969
igpm.5040	0.0000749	0.0003194	0.0009235	0.0026554	0.0046103	0.0065875	0.0085395	0.0105791	0.0143149	0.0176800	0.0319806	0.0434826	-0.0002132	0.0004796	0.0024094	0.0046098	0.0066267	0.0082384	0.0097887	0.0122123
igpm.6300	0.0000889	0.0003852	0.0011207	0.0032365	0.0056322	0.0080487	0.0104216	0.0128910	0.0173992	0.0214610	0.0388532	0.0529417	-0.0003287	0.0004187	0.0026732	0.0053429	0.0077890	0.0097174	0.0115399	0.0143451
igpm.7560	0.0001018	0.0004478	0.0013111	0.0038000	0.0066219	0.0094602	0.0122352	0.0151140	0.0203556	0.0250782	0.0453957	0.0619198	-0.0004237	0.0003769	0.0029448	0.0060720	0.0089375	0.0111747	0.0132616	0.0164304
igpm.8820	0.0001143	0.0005087	0.0014973	0.0043524	0.0075912	0.0108410	0.0140075	0.0172845	0.0232388	0.0286031	0.0517584	0.0706399	-0.0005084	0.0003456	0.0032209	0.0067977	0.0100760	0.0126175	0.0149647	0.0184895
igpm.10080	0.0001265	0.0005687	0.0016810	0.0048981	0.0085485	0.0122040	0.0157563	0.0194258	0.0260821	0.0320787	0.0580271	0.0792262	-0.0005878	0.0003203	0.0035004	0.0075220	0.0112091	0.0140523	0.0166580	0.0205361
igpm.11340	0.0001386	0.0006283	0.0018635	0.0054400	0.0094988	0.0135569	0.0174921	0.0215511	0.0289046	0.0355287	0.0642481	0.0877448	-0.0006645	0.0002989	0.0037828	0.0082465	0.0123400	0.0154835	0.0183472	0.0225782
igpm.12600	0.0001507	0.0006876	0.0020452	0.0059797	0.0104453	0.0149043	0.0192209	0.0236680	0.0317163	0.0389659	0.0704456	0.0962299	-0.0007395	0.0002801	0.0040678	0.0089721	0.0134705	0.0169138	0.0200352	0.0246198
ipca.63	0.0000035	0.0000128	0.0000268	0.0000459	0.0000531	0.0000530	0.0000486	0.0000423	0.0000255	0.0000085	-0.0000763	-0.0001742	0.0001231	0.0001575	0.0001937	0.0001959	0.0001897	0.0001860	0.0001923	0.0002075
ipca.126	0.0000043	0.0000152	0.0000316	0.0000484	0.0000446	0.0000325	0.0000189	0.0000059	-0.0000187	-0.0000422	-0.0001739	-0.0003083	0.0001481	0.0001802	0.0002077	0.0002084	0.0002000	0.0001914	0.0001911	0.0001918
ipca.252	0.0000073	0.0000325	0.0000858	0.0001955	0.0002730	0.0003262	0.0003672	0.0004072	0.0004692	0.0005166	0.0006371	0.0006638	0.0002177	0.0002982	0.0003968	0.0004578	0.0005001	0.0005288	0.0005662	0.0006169
ipca.378	0.0000099	0.0000491	0.0001432	0.0003740	0.0005794	0.0007493	0.0008951	0.0010383	0.0012759	0.0014744	0.0022182	0.0027284	0.0002052	0.0003161	0.0005029	0.0006665	0.0008045	0.0009096	0.0010184	0.0011716
ipca.504	0.0000119	0.0000611	0.0001858	0.0005174	0.0008414	0.0011281	0.0013836	0.0016367	0.0020656	0.0024304	0.0038808	0.0049710	0.0001401	0.0002557	0.0005065	0.0007669	0.0010017	0.0011873	0.0013697	0.0016320
ipca.630	0.0000133	0.0000686	0.0002128	0.0006140	0.0010281	0.0014090	0.0017564	0.0021024	0.0026951	0.0032025	0.0052583	0.0068566	0.0000635	0.0001711	0.0004618	0.0007970	0.0011100	0.0013624	0.0016048	0.0019576
ipca.756	0.0000151	0.0000775	0.0002424	0.0007150	0.0012208	0.0016985	0.0021409	0.0025833	0.0033462	0.0040009	0.0066685	0.0087734	-0.0000040	0.0000983	0.0004335	0.0008475	0.0012419	0.0015632	0.0018679	0.0023138
ipca.1008	0.0000178	0.0000903	0.0002832	0.0008551	0.0014952	0.0021200	0.0027101	0.0033043	0.0043371	0.0052242	0.0088301	0.0116966	-0.0001158	-0.0000251	0.0003829	0.0009254	0.0014505	0.0018816	0.0022847	0.0028766
ipca.1260	0.0000199	0.0000993	0.0003106	0.0009479	0.0016797	0.0024085	0.0031057	0.0038114	0.0050451	0.0061051	0.0103793	0.0137637	-0.0001991	-0.0001167	0.0003561	0.0010042	0.0016332	0.0021495	0.0026284	0.0033310
ipca.2520	0.0000289	0.0001356	0.0004197	0.0013054	0.0023757	0.0034883	0.0045861	0.0057143	0.0077207	0.0094519	0.0162728	0.0215616	-0.0005487	-0.0004983	0.0003048	0.0014506	0.0025419	0.0034179	0.0042101	0.0053615

Tabela 3 – Matriz de Fatores de Risco – Partição B

	igpm.1260	igpm.2520	igpm.3780	igpm.5040	igpm.6300	igpm.7560	igpm.8820	igpm.10080	igpm.11340	igpm.12600	ipca.63	ipca.126	ipca.252	ipca.378	ipca.504	ipca.630	ipca.756	ipca.1008	ipca.1260	ipca.2520
pre.21	0.0000196	0.0000401	0.0000591	0.0000749	0.0000889	0.0001018	0.0001143	0.0001265	0.0001386	0.0001507	0.0000035	0.0000043	0.0000073	0.0000099	0.0000119	0.0000133	0.0000151	0.0000178	0.0000199	0.0000289
pre.63	0.0000884	0.0001706	0.0002488	0.0003194	0.0003852	0.0004478	0.0005087	0.0005687	0.0006283	0.0006876	0.0000128	0.0000152	0.0000325	0.0000491	0.0000611	0.0000686	0.0000775	0.0000903	0.0000993	0.0001356
pre.126	0.0002599	0.0004936	0.0007163	0.0009235	0.0011207	0.0013111	0.0014973	0.0016810	0.0018635	0.0020452	0.0000268	0.0000316	0.0000858	0.0001432	0.0001858	0.0002128	0.0002424	0.0002832	0.0003106	0.0004197
pre.252	0.0007286	0.0014049	0.0020497	0.0026554	0.0032365	0.0038000	0.0043524	0.0048981	0.0054400	0.0059797	0.0000459	0.0000484	0.0001955	0.0003740	0.0005174	0.0006140	0.0007150	0.0008551	0.0009479	0.0013054
pre.378	0.0012070	0.0024001	0.0035418	0.0046103	0.0056322	0.0066219	0.0075912	0.0085485	0.0094988	0.0104453	0.0000531	0.0000446	0.0002730	0.0005794	0.0008414	0.0010281	0.0012208	0.0014952	0.0016797	0.0023757
pre.504	0.0016662	0.0033979	0.0050517	0.0065875	0.0080487	0.0094602	0.0108410	0.0122040	0.0135569	0.0149043	0.0000530	0.0000325	0.0003262	0.0007493	0.0011281	0.0014090	0.0016985	0.0021200	0.0024085	0.0034883
pre.630	0.0021171	0.0043913	0.0065508	0.0085395	0.0104216	0.0122352	0.0140075	0.0157563	0.0174921	0.0192209	0.0000486	0.0000189	0.0003672	0.0008951	0.0013836	0.0017564	0.0021409	0.0027101	0.0031057	0.0045861
pre.756	0.0025937	0.0054398	0.0081251	0.0105791	0.0128910	0.0151140	0.0172845	0.0194258	0.0215511	0.0236680	0.0000423	0.0000059	0.0004072	0.0010383	0.0016367	0.0021024	0.0025833	0.0033043	0.0038114	0.0057143
pre.1008	0.0034655	0.0073712	0.0110192	0.0143149	0.0173992	0.0203556	0.0232388	0.0260821	0.0289046	0.0317163	0.0000255	-0.0000187	0.0004692	0.0012759	0.0020656	0.0026951	0.0033462	0.0043371	0.0050451	0.0077207
pre.1260	0.0042295	0.0090979	0.0136225	0.0176800	0.0214610	0.0250782	0.0286031	0.0320787	0.0355287	0.0389659	0.0000085	-0.0000422	0.0005166	0.0014744	0.0024304	0.0032025	0.0040009	0.0052242	0.0061051	0.0094519
pre.2520	0.0070116	0.0160615	0.0245250	0.0319806	0.0388532	0.0453957	0.0517584	0.0580271	0.0642481	0.0704456	-0.0000763	-0.0001739	0.0006371	0.0022182	0.0038808	0.0052583	0.0066685	0.0088301	0.0103793	0.0162728
pre.3780	0.0088365	0.0213275	0.0331552	0.0434826	0.0529417	0.0619198	0.0706399	0.0792262	0.0877448	0.0962299	-0.0001742	-0.0003083	0.0006638	0.0027284	0.0049710	0.0068566	0.0087734	0.0116966	0.0137637	0.0215616
igpm.63	0.0003412	0.0001392	-0.0000607	-0.0002132	-0.0003287	-0.0004237	-0.0005084	-0.0005878	-0.0006645	-0.0007395	0.0001231	0.0001481	0.0002177	0.0002052	0.0001401	0.0000635	-0.0000040	-0.0001158	-0.0001991	-0.0005487
igpm.126	0.0007077	0.0006832	0.0005716	0.0004796	0.0004187	0.0003769	0.0003456	0.0003203	0.0002989	0.0002801	0.0001575	0.0001802	0.0002982	0.0003161	0.0002557	0.0001711	0.0000983	-0.0000251	-0.0001167	-0.0004983
igpm.252	0.0014294	0.0018795	0.0021570	0.0024094	0.0026732	0.0029448	0.0032209	0.0035004	0.0037828	0.0040678	0.0001937	0.0002077	0.0003968	0.0005029	0.0005065	0.0004618	0.0004335	0.0003829	0.0003561	0.0003048
igpm.378	0.0021212	0.0030923	0.0038733	0.0046098	0.0053429	0.0060720	0.0067977	0.0075220	0.0082465	0.0089721	0.0001959	0.0002084	0.0004578	0.0006665	0.0007669	0.0007970	0.0008475	0.0009254	0.0010042	0.0014506
igpm.504	0.0027447	0.0042095	0.0054489	0.0066267	0.0077890	0.0089375	0.0100760	0.0112091	0.0123400	0.0134705	0.0001897	0.0002000	0.0005001	0.0008045	0.0010017	0.0011100	0.0012419	0.0014505	0.0016332	0.0025419
igpm.630	0.0032541	0.0051393	0.0067316	0.0082384	0.0097174	0.0111747	0.0126175	0.0140523	0.0154835	0.0169138	0.0001860	0.0001914	0.0005288	0.0009096	0.0011873	0.0013624	0.0015632	0.0018816	0.0021495	0.0034179
igpm.756	0.0037697	0.0060789	0.0079947	0.0097887	0.0115399	0.0132616	0.0149647	0.0166580	0.0183472	0.0200352	0.0001923	0.0001911	0.0005662	0.0010184	0.0013697	0.0016048	0.0018679	0.0022847	0.0026284	0.0042101
igpm.1008	0.0045252	0.0075640	0.0099969	0.0122123	0.0143451	0.0164304	0.0184895	0.0205361	0.0225782	0.0246198	0.0002075	0.0001918	0.0006169	0.0011716	0.0016320	0.0019576	0.0023138	0.0028766	0.0033310	0.0053615
igpm.1260	0.0052604	0.0091276	0.0121861	0.0148995	0.0174724	0.0199708	0.0224311	0.0248744	0.0273119	0.0297490	0.0002318	0.0002011	0.0006794	0.0013351	0.0018994	0.0023092	0.0027529	0.0034528	0.0040124	0.0064855
igpm.2520	0.0091276	0.0187685	0.0273151	0.0347388	0.0415548	0.0480367	0.0543441	0.0605659	0.0667491	0.0729170	0.0003992	0.0002654	0.0011000	0.0023898	0.0035752	0.0044778	0.0054390	0.0069661	0.0081888	0.0136398
igpm.3780	0.0121861	0.0273151	0.0422290	0.0556513	0.0680938	0.0799417	0.0914518	0.1027791	0.1140102	0.1251916	0.0005330	0.0002878	0.0014865	0.0034022	0.0051712	0.0065204	0.0079496	0.0102332	0.0120822	0.0204558
igpm.5040	0.0148995	0.0347388	0.0556513	0.0750738	0.0933256	0.1107973	0.1277935	0.1445134	0.1610757	0.1775477	0.0006311	0.0002885	0.0018569	0.0043770	0.0066822	0.0084224	0.0102574	0.0131890	0.0155784	0.0265312
igpm.6300	0.0174724	0.0415548	0.0680938	0.0933256	0.1173028	0.1403664	0.1628384	0.1849482	0.2068401	0.2285998	0.0007089	0.0002792	0.0022192	0.0053294	0.0081437	0.0102440	0.0124495	0.0159652	0.0188414	0.0321460
igpm.7560	0.0199708	0.0480367	0.0799417	0.1107973	0.1403664	0.1689161	0.1967712	0.2241838	0.2513202	0.2782828	0.0007762	0.0002657	0.0025742	0.0062624	0.0095687	0.0120118	0.0145685	0.0186339	0.0219672	0.0374922
igpm.8820	0.0224311	0.0543441	0.0914518	0.1277935	0.1628384	0.1967712	0.2299135	0.2625366	0.2948267	0.3269022	0.0008388	0.0002510	0.0029241	0.0071811	0.0109690	0.0137459	0.0166438	0.0212414	0.0250166	0.0426915
igpm.10080	0.0248744	0.0605659	0.1027791	0.1445134	0.1849482	0.2241838	0.2625366	0.3002952	0.3376655	0.3747811	0.0008997	0.0002364	0.0032710	0.0080906	0.0123543	0.0154602	0.0186944	0.0238161	0.0280259	0.0478149
igpm.11340	0.0273119	0.0667491	0.1140102	0.1610757	0.2068401	0.2513202	0.2948267	0.3376655	0.3800612	0.4221628	0.0009603	0.0002226	0.0036164	0.0089946	0.0137308	0.0171635	0.0207319	0.0263740	0.0310152	0.0529010
igpm.12600	0.0297490	0.0729170	0.1251916	0.1775477	0.2285998	0.2782828	0.3269022	0.3747811	0.4221628	0.4692113	0.0010211	0.0002096	0.0039612	0.0098956	0.0151024	0.0188610	0.0227626	0.0289238	0.0339952	0.0579698
ipca.63	0.0002318	0.0003992	0.0005330	0.0006311	0.0007089	0.0007762	0.0008388	0.0008997	0.0009603	0.0010211	0.0003625	0.0001717	0.0001688	0.0002148	0.0002304	0.0002258	0.0002285	0.0002325	0.0002417	0.0003412
ipca.126	0.0002011	0.0002654	0.0002878	0.0002885	0.0002792	0.0002657	0.0002510	0.0002364	0.0002226	0.0002096	0.0001717	0.0001611	0.0001881	0.0001911	0.0001833	0.0001749	0.0001801	0.0001958	0.0002130	0.0002706
ipca.252	0.0006794	0.0011000	0.0014865	0.0018569	0.0022192	0.0025742	0.0029241	0.0032710	0.0036164	0.0039612	0.0001688	0.0001881	0.0003741	0.0005230	0.0006052	0.0006411	0.0006936	0.0007673	0.0008233	0.0010687
ipca.378	0.0013351	0.0023898	0.0034022	0.0043770	0.0053294	0.0062624	0.0071811	0.0080906	0.0089946	0.0098956	0.0002148	0.0001911	0.0005230	0.0008771	0.0011150	0.0012446	0.0013868	0.0015733	0.0017023	0.0023038
ipca.504	0.0018994	0.0035752	0.0051712	0.0066822	0.0081437	0.0095687	0.0109690	0.0123543	0.0137308	0.0151024	0.0002304	0.0001833	0.0006052	0.0011150	0.0014963	0.0017305	0.0019754	0.0023051	0.0025289	0.0035075
ipca.630	0.0023092	0.0044778	0.0065204	0.0084224	0.0102440	0.0120118	0.0137459	0.0154602	0.0171635	0.0188610	0.0002258	0.0001749	0.0006411	0.0012446	0.0017305	0.0020548	0.0023923	0.0028636	0.0031860	0.0045016
ipca.756	0.0027529	0.0054390	0.0079496	0.0102574	0.0124495	0.0145685	0.0166438	0.0186944	0.0207319	0.0227626	0.0002285	0.0001801	0.0006936	0.0013868	0.0019754	0.0023923	0.0028289	0.0034596	0.0038981	0.0056007
ipca.1008	0.0034528	0.0069661	0.0102332	0.0131890	0.0159652	0.0186339	0.0212414	0.0238161	0.0263740	0.0289238	0.0002325	0.0001958	0.0007673	0.0015733	0.0023051	0.0028636	0.0034596	0.0043667	0.0050216	0.0074510
ipca.1260	0.0040124	0.0081888	0.0120822	0.0155784	0.0188414	0.0219672	0.0250166	0.0280259	0.0310152	0.0339952	0.0002417	0.0002130	0.0008233	0.0017023	0.0025289	0.0031860	0.0038981	0.0050216	0.0058611	0.0089752
ipca.2520	0.0064855	0.0136398	0.0204558	0.0265312	0.0321460	0.0374922	0.0426915	0.0478149	0.0529010	0.0579698	0.0003412	0.0002706	0.0010687	0.0023038	0.0035075	0.0045016	0.0056007	0.0074510	0.0089752	0.0156025

Tabela 4 – Matriz de Fatores de Risco – Partição C

	ipca.3780	ipca.5040	ipca.6300	ipca.7560	ipca.8820	ipca.10080	ipca.11340	ipca.12600	tr.63	tr.126	tr.252	tr.378	tr.504	tr.630	tr.756	tr.1008	tr.1260	tr.2520	tr.3780	tr.5040
pre.21	0.0000359	0.0000451	0.0000571	0.0000768	0.0000964	0.0001125	0.0001264	0.0001381	0.0000015	0.0000028	0.0000048	0.0000062	0.0000072	0.0000083	0.0000094	0.0000113	0.0000126	0.0000226	0.0000317	0.0000408
pre.63	0.0001658	0.0002057	0.0002535	0.0003274	0.0003949	0.0004456	0.0004886	0.0005244	0.0000046	0.0000094	0.0000173	0.0000234	0.0000279	0.0000328	0.0000372	0.0000454	0.0000507	0.0000928	0.0001335	0.0001742
pre.126	0.0005167	0.0006382	0.0007681	0.0009608	0.0011246	0.0012395	0.0013370	0.0014209	0.0000099	0.0000215	0.0000432	0.0000614	0.0000755	0.0000905	0.0001043	0.0001297	0.0001464	0.0002741	0.0003980	0.0005222
pre.252	0.0016362	0.0020270	0.0024042	0.0029372	0.0033565	0.0036279	0.0038604	0.0040697	0.0000199	0.0000476	0.0001066	0.0001611	0.0002069	0.0002561	0.0003021	0.0003876	0.0004458	0.0008555	0.0012425	0.0016276
pre.378	0.0030220	0.0037662	0.0044595	0.0054198	0.0061596	0.0066306	0.0070407	0.0074199	0.0000280	0.0000703	0.0001673	0.0002630	0.0003474	0.0004393	0.0005268	0.0006912	0.0008060	0.0015749	0.0022847	0.0029857
pre.504	0.0044840	0.0056092	0.0066408	0.0080605	0.0091528	0.0098543	0.0104758	0.0110607	0.0000349	0.0000900	0.0002220	0.0003580	0.0004820	0.0006184	0.0007500	0.0009996	0.0011771	0.0023330	0.0033846	0.0044167
pre.630	0.0059374	0.0074403	0.0088038	0.0106778	0.0121248	0.0130666	0.0139149	0.0147240	0.0000411	0.0001077	0.0002719	0.0004461	0.0006085	0.0007887	0.0009639	0.0012992	0.0015407	0.0030897	0.0044864	0.0058511
pre.756	0.0074346	0.0093213	0.0110187	0.0133534	0.0151640	0.0163581	0.0174492	0.0185017	0.0000474	0.0001255	0.0003220	0.0005347	0.0007360	0.0009607	0.0011808	0.0016045	0.0019130	0.0038741	0.0056332	0.0073466
pre.1008	0.0101043	0.0126609	0.0149309	0.0180651	0.0205154	0.0221686	0.0237154	0.0252342	0.0000577	0.0001551	0.0004066	0.0006857	0.0009552	0.0012585	0.0015584	0.0021410	0.0025719	0.0052886	0.0077157	0.0100709
pre.1260	0.0124077	0.0155287	0.0182734	0.0220796	0.0250769	0.0271364	0.0290981	0.0310492	0.0000658	0.0001791	0.0004762	0.0008111	0.0011386	0.0015094	0.0018783	0.0025995	0.0031388	0.0065288	0.0095563	0.0124891
pre.2520	0.0214686	0.0267810	0.0313375	0.0377279	0.0428483	0.0465195	0.0501555	0.0538664	0.0000921	0.0002625	0.0007251	0.0012685	0.0018206	0.0024576	0.0031035	0.0043899	0.0053813	0.0115857	0.0171595	0.0225501
pre.3780	0.0285305	0.0355870	0.0415325	0.0498318	0.0564146	0.0610866	0.0657222	0.0704615	0.0001082	0.0003179	0.0008938	0.0015860	0.0023067	0.0031492	0.0040137	0.0057532	0.0071148	0.0156143	0.0232813	0.0306955
igpm.63	-0.0009271	-0.0012512	-0.0014359	-0.0016170	-0.0016956	-0.0017180	-0.0017685	-0.0018582	0.0000105	0.0000162	0.0000073	-0.0000202	-0.0000555	-0.0000958	-0.0001367	-0.0002148	-0.0002714	-0.0005495	-0.0007559	-0.0009467
igpm.126	-0.0009627	-0.0013974	-0.0016697	-0.0019168	-0.0020164	-0.0020251	-0.0020517	-0.0021164	0.0000177	0.0000308	0.0000322	0.0000089	-0.0000268	-0.0000687	-0.0001129	-0.0001991	-0.0002640	-0.0005637	-0.0007759	-0.0009668
igpm.252	0.0001048	-0.0001151	-0.0002382	-0.0002611	-0.0001850	-0.0000598	0.0000692	0.0001838	0.0000300	0.0000600	0.0000962	0.0001046	0.0000960	0.0000839	0.0000688	0.0000395	0.0000174	0.0000211	0.0000968	0.0001894
igpm.378	0.0017001	0.0018977	0.0020996	0.0025140	0.0029219	0.0032756	0.0036399	0.0040063	0.0000381	0.0000818	0.0001520	0.0001967	0.0002232	0.0002513	0.0002767	0.0003284	0.0003689	0.0007756	0.0012193	0.0016715
igpm.504	0.0031993	0.0037915	0.0043283	0.0052079	0.0059890	0.0066072	0.0072271	0.0078488	0.0000434	0.0000977	0.0001956	0.0002716	0.0003291	0.0003929	0.0004544	0.0005781	0.0006740	0.0014291	0.0021878	0.0029476
igpm.630	0.0043797	0.0052755	0.0060893	0.0073673	0.0084823	0.0093437	0.0101906	0.0110290	0.0000473	0.0001092	0.0002282	0.0003283	0.0004101	0.0005018	0.0005915	0.0007711	0.0009097	0.0019298	0.0029260	0.0039171
igpm.756	0.0054234	0.0065713	0.0076254	0.0092628	0.0106901	0.0117860	0.0128513	0.0138954	0.0000520	0.0001218	0.0002609	0.0003832	0.0004867	0.0006034	0.0007180	0.0009468	0.0011227	0.0023789	0.0035879	0.0047864
igpm.1008	0.0069198	0.0084042	0.0097844	0.0119307	0.0138177	0.0152756	0.0166858	0.0180589	0.0000598	0.0001417	0.0003108	0.0004666	0.0006030	0.0007570	0.0009090	0.0012114	0.0014428	0.0030507	0.0045749	0.0060789
igpm.1260	0.0083767	0.0101605	0.0118162	0.0144132	0.0167211	0.0185310	0.0202959	0.0220220	0.0000697	0.0001650	0.0003656	0.0005551	0.0007237	0.0009144	0.0011029	0.0014775	0.0017638	0.0037279	0.0055752	0.0073930
igpm.2520	0.0177960	0.0214646	0.0247116	0.0299623	0.0347844	0.0387841	0.0428623	0.0469731	0.0001352	0.0003155	0.0007110	0.0011051	0.0014675	0.0018795	0.0022896	0.0031057	0.0037324	0.0079381	0.0118507	0.0156834
igpm.3780	0.0268461	0.0323497	0.0371106	0.0448599	0.0520198	0.0580366	0.0642472	0.0705594	0.0001882	0.0004419	0.0010078	0.0015823	0.0021164	0.0027248	0.0033325	0.0045445	0.0054779	0.0116932	0.0174609	0.0231071
igpm.5040	0.0348963	0.0420201	0.0481095	0.0580452	0.0672302	0.0749749	0.0830075	0.0911988	0.0002303	0.0005471	0.0012607	0.0019905	0.0026720	0.0034488	0.0042258	0.0057768	0.0069731	0.0149058	0.0222576	0.0294526
igpm.6300	0.0423153	0.0509173	0.0582140	0.0701404	0.0811631	0.0904709	0.1001526	0.1100458	0.0002669	0.0006415	0.0014905	0.0023621	0.0031775	0.0041070	0.0050375	0.0068956	0.0083296	0.0178169	0.0266021	0.0351989
igpm.7560	0.0493669	0.0593662	0.0678030	0.0816119	0.0943706	0.1051535	0.1163917	0.1278919	0.0003007	0.0007303	0.0017080	0.0027138	0.0036558	0.0047294	0.0058046	0.0079524	0.0096104	0.0205641	0.0307016	0.0406207
igpm.8820	0.0562187	0.0675729	0.0771160	0.0927520	0.1071950	0.1194084	0.1321556	0.1452137	0.0003333	0.0008163	0.0019191	0.0030553	0.0041200	0.0053334	0.0065488	0.0089771	0.0108523	0.0232271	0.0346753	0.0458763
igpm.10080	0.0629675	0.0756558	0.0862892	0.1037261	0.1198288	0.1334512	0.1476841	0.1622756	0.0003654	0.0009010	0.0021272	0.0033920	0.0045775	0.0059285	0.0072820	0.0099866	0.0120755	0.0258497	0.0385888	0.0510522
igpm.11340	0.0696657	0.0836785	0.0953954	0.1146214	0.1323730	0.1473946	0.1631025	0.1792158	0.0003973	0.0009853	0.0023342	0.0037266	0.0050322	0.0065199	0.0080105	0.0109894	0.0132904	0.0284544	0.0424756	0.0561930
igpm.12600	0.0763405	0.0916735	0.1044715	0.1254823	0.1448786	0.1612955	0.1784738	0.1961038	0.0004293	0.0010696	0.0025409	0.0040606	0.0054859	0.0071099	0.0087373	0.0119897	0.0145023	0.0310524	0.0463524	0.0613205
ipca.63	0.0004632	0.0006413	0.0008421	0.0010864	0.0012379	0.0012646	0.0012140	0.0011085	0.0000061	0.0000121	0.0000213	0.0000262	0.0000275	0.0000277	0.0000265	0.0000224	0.0000175	0.0000230	0.0000646	0.0001232
ipca.126	0.0003000	0.0003880	0.0005295	0.0007328	0.0008987	0.0009876	0.0010223	0.0010136	0.0000121	0.0000239	0.0000403	0.0000482	0.0000507	0.0000529	0.0000538	0.0000546	0.0000532	0.0000767	0.0001093	0.0001450
ipca.252	0.0012564	0.0015247	0.0018546	0.0023671	0.0028207	0.0031461	0.0034139	0.0036330	0.0000261	0.0000569	0.0001114	0.0001519	0.0001796	0.0002084	0.0002335	0.0002789	0.0003072	0.0005595	0.0008173	0.0010792
ipca.378	0.0028559	0.0035309	0.0042530	0.0053343	0.0062727	0.0069553	0.0075532	0.0080827	0.0000381	0.0000876	0.0001853	0.0002681	0.0003329	0.0004019	0.0004654	0.0005836	0.0006638	0.0012753	0.0018777	0.0024841
ipca.504	0.0044264	0.0055300	0.0066809	0.0083736	0.0098318	0.0108907	0.0118244	0.0126602	0.0000475	0.0001120	0.0002462	0.0003674	0.0004681	0.0005772	0.0006801	0.0008743	0.0010103	0.0019835	0.0029168	0.0038476
ipca.630	0.0057149	0.0071769	0.0087012	0.0109251	0.0128347	0.0142146	0.0154254	0.0165054	0.0000541	0.0001291	0.0002898	0.0004406	0.0005703	0.0007125	0.0008484	0.0011071	0.0012912	0.0025644	0.0037634	0.0049513
ipca.756	0.0071240	0.0089668	0.0108970	0.0137037	0.0161084	0.0178367	0.0193425	0.0206764	0.0000621	0.0001489	0.0003385	0.0005210	0.0006816	0.0008590	0.0010300	0.0013575	0.0015929	0.0031873	0.0046712	0.0061344
ipca.1008	0.0095000	0.0119661	0.0145624	0.0183327	0.0215523	0.0238453	0.0258199	0.0275489	0.0000741	0.0001781	0.0004104	0.0006413	0.0008501	0.0010830	0.0013099	0.0017480	0.0020672	0.0041827	0.0061259	0.0080308
ipca.1260	0.0115038	0.0144832	0.0176038	0.0221357	0.0259936	0.0287245	0.0310628	0.0330981	0.0000830	0.0001989	0.0004613	0.0007269	0.0009711	0.0012452	0.0015142	0.0020367	0.0024216	0.0049466	0.0072533	0.0095074
ipca.2520	0.0212651	0.0271438	0.0327095	0.0405318	0.0469506	0.0513325	0.0550810	0.0583657	0.0001207	0.0002841	0.0006623	0.0010620	0.0014436	0.0018798	0.0023163	0.0031826	0.0038443	0.0081512	0.0120909	0.0159272

Tabela 5 – Matriz de Fatores de Risco – Partição D

	tr.6300	tr.7560	tr.8820	tr.10080	tr.11340	tr.12600	dolar.30	dolar.90	dolar.180	dolar.360	dolar.540	dolar.720	dolar.900	dolar.1080	dolar.1440	dolar.1800	dolar.3600	igpm	ipca	tr	ibovespa	dolar	commodity
pre.21	0.0000497	0.0000586	0.0000675	0.0000764	0.0000853	0.0000941	0.0000001	0.0000002	0.0000003	0.0000006	0.0000009	0.0000011	0.0000014	0.0000018	0.0000026	0.0000034	0.0000029	-0.0000057	-0.0000015	0.0000001	0.0000437	-0.0000104	-0.0000281
pre.63	0.0002146	0.0002548	0.0002949	0.0003349	0.0003749	0.0004148	0.0000002	0.0000007	0.0000013	0.0000023	0.0000032	0.0000040	0.0000050	0.0000061	0.0000086	0.0000107	0.0000073	-0.0000214	-0.0000060	0.0000009	0.0001438	-0.0000179	-0.0000713
pre.126	0.0006456	0.0007686	0.0008911	0.0010135	0.0011356	0.0012577	0.0000005	0.0000014	0.0000026	0.0000048	0.0000067	0.0000085	0.0000107	0.0000128	0.0000171	0.0000194	-0.0000062	-0.0000526	-0.0000153	0.0000031	0.0003335	-0.0000315	-0.0000931
pre.252	0.0020102	0.0023910	0.0027707	0.0031497	0.0035282	0.0039064	0.0000006	0.0000018	0.0000036	0.0000075	0.0000115	0.0000154	0.0000196	0.0000228	0.0000268	0.0000234	-0.0000784	-0.0001137	-0.0000325	0.0000086	0.0008263	-0.0001533	-0.0001182
pre.378	0.0036805	0.0043717	0.0050607	0.0057484	0.0064354	0.0071218	0.0000003	0.0000009	0.0000022	0.0000067	0.0000127	0.0000189	0.0000252	0.0000296	0.0000333	0.0000240	-0.0001432	-0.0001519	-0.0000451	0.0000131	0.0014729	-0.0004536	-0.0002101
pre.504	0.0054377	0.0064526	0.0074642	0.0084740	0.0094826	0.0104904	-0.0000003	-0.0000007	-0.0000005	0.0000038	0.0000115	0.0000201	0.0000287	0.0000350	0.0000400	0.0000283	-0.0001793	-0.0001739	-0.0000554	0.0000164	0.0022316	-0.0008734	-0.0003190
pre.630	0.0071989	0.0085380	0.0098725	0.0112046	0.0125351	0.0138647	-0.0000010	-0.0000025	-0.0000035	0.0000002	0.0000095	0.0000204	0.0000314	0.0000396	0.0000472	0.0000350	-0.0001988	-0.0001892	-0.0000650	0.0000189	0.0030480	-0.0013407	-0.0003940
pre.756	0.0090368	0.0107154	0.0123881	0.0140575	0.0157251	0.0173915	-0.0000016	-0.0000043	-0.0000064	-0.0000031	0.0000078	0.0000211	0.0000346	0.0000450	0.0000556	0.0000432	-0.0002182	-0.0002053	-0.0000752	0.0000211	0.0039382	-0.0018395	-0.0004272
pre.1008	0.0123907	0.0146933	0.0169873	0.0192768	0.0215637	0.0238490	-0.0000027	-0.0000072	-0.0000112	-0.0000081	0.0000065	0.0000249	0.0000438	0.0000587	0.0000748	0.0000604	-0.0002784	-0.0002340	-0.0000935	0.0000238	0.0056776	-0.0027911	-0.0003641
pre.1260	0.0153754	0.0182394	0.0210923	0.0239394	0.0267832	0.0296249	-0.0000037	-0.0000099	-0.0000154	-0.0000113	0.0000082	0.0000329	0.0000581	0.0000780	0.0000990	0.0000785	-0.0003969	-0.0002635	-0.0001107	0.0000251	0.0073572	-0.0036908	-0.0001882
pre.2520	0.0278492	0.0331041	0.0383370	0.0435583	0.0487729	0.0539833	-0.0000104	-0.0000283	-0.0000440	-0.0000318	0.0000259	0.0000990	0.0001732	0.0002304	0.0002784	0.0001756	-0.0018884	-0.0004573	-0.0002136	0.0000252	0.0153426	-0.0082058	0.0013765
pre.3780	0.0379818	0.0452056	0.0523982	0.0595741	0.0667404	0.0739006	-0.0000186	-0.0000509	-0.0000801	-0.0000613	0.0000398	0.0001697	0.0003023	0.0004040	0.0004807	0.0002643	-0.0040214	-0.0006906	-0.0003356	0.0000235	0.0221521	-0.0124935	0.0031113
igpm.63	-0.0011324	-0.0013165	-0.0015000	-0.0016833	-0.0018666	-0.0020499	-0.0000015	-0.0000037	-0.0000049	-0.0000010	0.0000075	0.0000156	0.0000220	0.0000256	0.0000268	0.0000210	-0.0000242	-0.0001154	-0.0000251	-0.0000049	0.0001737	0.0002708	0.0010141
igpm.126	-0.0011505	-0.0013319	-0.0015126	-0.0016931	-0.0018737	-0.0020543	-0.0000012	-0.0000030	-0.0000042	-0.0000023	0.0000026	0.0000071	0.0000101	0.0000108	0.0000069	-0.0000028	-0.0000783	-0.0001554	-0.0000307	-0.0000059	0.0002484	0.0005188	0.0013175
igpm.252	0.0002860	0.0003833	0.0004802	0.0005766	0.0006726	0.0007683	-0.0000003	-0.0000009	-0.0000021	-0.0000061	-0.0000116	-0.0000182	-0.0000269	-0.0000367	-0.0000620	-0.0000895	-0.0001894	-0.0001870	-0.0000245	-0.0000053	0.0010899	0.0004880	0.0013725
igpm.378	0.0021234	0.0025737	0.0030223	0.0034698	0.0039164	0.0043624	0.0000000	-0.0000004	-0.0000020	-0.0000090	-0.0000192	-0.0000307	-0.0000447	-0.0000594	-0.0000958	-0.0001334	-0.0002452	-0.0002111	-0.0000161	-0.0000038	0.0020888	0.0001659	0.0011532
igpm.504	0.0037036	0.0044560	0.0052059	0.0059540	0.0067008	0.0074468	0.0000003	0.0000007	0.0000001	-0.0000051	-0.0000139	-0.0000244	-0.0000374	-0.0000515	-0.0000869	-0.0001248	-0.0002420	-0.0002388	-0.0000111	-0.0000026	0.0029464	-0.0002700	0.0009756
igpm.630	0.0049016	0.0058812	0.0068574	0.0078314	0.0088039	0.0097754	0.0000008	0.0000022	0.0000035	0.0000027	-0.0000016	-0.0000082	-0.0000171	-0.0000275	-0.0000551	-0.0000872	-0.0002052	-0.0002637	-0.0000093	-0.0000017	0.0036130	-0.0007180	0.0009221
igpm.756	0.0059756	0.0071587	0.0083377	0.0095140	0.0106887	0.0118621	0.0000013	0.0000038	0.0000070	0.0000114	0.0000122	0.0000103	0.0000065	0.0000006	-0.0000172	-0.0000418	-0.0001634	-0.0002926	-0.0000099	-0.0000012	0.0042607	-0.0011616	0.0010017
igpm.1008	0.0075693	0.0090514	0.0105283	0.0120021	0.0134739	0.0149442	0.0000018	0.0000057	0.0000119	0.0000250	0.0000358	0.0000436	0.0000509	0.0000550	0.0000589	0.0000515	-0.0000785	-0.0003336	-0.0000150	-0.0000003	0.0052745	-0.0019218	0.0012917
igpm.1260	0.0091926	0.0109815	0.0127643	0.0145433	0.0163198	0.0180946	0.0000018	0.0000063	0.0000143	0.0000340	0.0000537	0.0000712	0.0000894	0.0001038	0.0001295	0.0001389	-0.0000099	-0.0003768	-0.0000229	0.0000009	0.0063810	-0.0026425	0.0016535
igpm.2520	0.0194708	0.0232336	0.0269826	0.0307236	0.0344594	0.0381919	0.0000032	0.0000110	0.0000263	0.0000705	0.0001258	0.0001861	0.0002573	0.0003256	0.0004714	0.0005778	0.0002878	-0.0006408	-0.0000716	0.0000145	0.0137188	-0.0064239	0.0029033
igpm.3780	0.0286845	0.0342248	0.0397446	0.0452522	0.0507523	0.0562475	0.0000096	0.0000290	0.0000572	0.0001173	0.0001835	0.0002590	0.0003559	0.0004555	0.0006841	0.0008680	0.0004856	-0.0008541	-0.0000983	0.0000329	0.0203510	-0.0092636	0.0029555
igpm.5040	0.0365591	0.0436178	0.0506501	0.0576669	0.0646741	0.0716750	0.0000175	0.0000505	0.0000928	0.0001634	0.0002274	0.0003018	0.0004057	0.0005184	0.0007912	0.0010211	0.0005568	-0.0010231	-0.0001060	0.0000516	0.0260164	-0.0114239	0.0026279
igpm.6300	0.0436893	0.0521222	0.0605235	0.0689063	0.0772776	0.0856414	0.0000252	0.0000714	0.0001268	0.0002051	0.0002626	0.0003303	0.0004340	0.0005520	0.0008496	0.0011069	0.0005441	-0.0011700	-0.0001045	0.0000700	0.0311732	-0.0133123	0.0022344
igpm.7560	0.0504166	0.0601462	0.0698390	0.0795106	0.0891688	0.0988184	0.0000325	0.0000911	0.0001587	0.0002433	0.0002932	0.0003528	0.0004539	0.0005741	0.0008884	0.0011638	0.0004869	-0.0013073	-0.0000993	0.0000881	0.0360696	-0.0150990	0.0018518
igpm.8820	0.0569379	0.0679243	0.0788692	0.0897900	0.1006958	0.1115918	0.0000394	0.0001098	0.0001891	0.0002795	0.0003218	0.0003732	0.0004711	0.0005926	0.0009203	0.0012099	0.0004099	-0.0014410	-0.0000929	0.0001059	0.0408383	-0.0168516	0.0014948
igpm.10080	0.0633603	0.0755846	0.0877627	0.0999140	0.1120486	0.1241722	0.0000461	0.0001280	0.0002185	0.0003146	0.0003496	0.0003931	0.0004879	0.0006106	0.0009507	0.0012530	0.0003259	-0.0015738	-0.0000862	0.0001235	0.0455480	-0.0185965	0.0011624
igpm.11340	0.0697392	0.0831931	0.0965961	0.1099695	0.1233246	0.1366677	0.0000527	0.0001458	0.0002474	0.0003492	0.0003772	0.0004131	0.0005051	0.0006291	0.0009817	0.0012962	0.0002408	-0.0017067	-0.0000796	0.0001408	0.0502330	-0.0203433	0.0008503
igpm.12600	0.0761017	0.0907820	0.1054068	0.1199993	0.1345717	0.1491310	0.0000591	0.0001633	0.0002758	0.0003834	0.0004048	0.0004334	0.0005229	0.0006484	0.0010137	0.0013405	0.0001571	-0.0018402	-0.0000734	0.0001581	0.0549098	-0.0220951	0.0005547
ipca.63	0.0001875	0.0002532	0.0003190	0.0003845	0.0004498	0.0005149	0.0000013	0.0000040	0.0000084	0.0000173	0.0000242	0.0000296	0.0000362	0.0000429	0.0000634	0.0000906	0.0002218	0.0000239	-0.0000030	-0.0000006	0.0004419	-0.0004035	0.0004757
ipca.126	0.0001816	0.0002182	0.0002548	0.0002914	0.0003278	0.0003643	0.0000011	0.0000032	0.0000062	0.0000116	0.0000156	0.0000189	0.0000229	0.0000269	0.0000381	0.0000517	0.0001127	0.0000010	-0.0000176	0.0000019	0.0003215	-0.0001334	0.0002609
ipca.252	0.0013408	0.0016017	0.0018618	0.0021214	0.0023807	0.0026397	0.0000008	0.0000025	0.0000050	0.0000103	0.0000152	0.0000195	0.0000241	0.0000281	0.0000369	0.0000454	0.0000867	-0.0000675	-0.0000325	0.0000073	0.0009749	-0.0001774	0.0005153
ipca.378	0.0030886	0.0036907	0.0042911	0.0048903	0.0054886	0.0060864	0.0000000	0.0000005	0.0000024	0.0000104	0.0000213	0.0000321	0.0000432	0.0000524	0.0000694	0.0000808	0.0000883	-0.0001387	-0.0000432	0.0000121	0.0019735	-0.0006214	0.0007117
ipca.504	0.0047729	0.0056939	0.0066121	0.0075285	0.0084436	0.0093579	-0.0000008	-0.0000014	0.0000003	0.0000119	0.0000299	0.0000486	0.0000681	0.0000843	0.0001140	0.0001316	0.0000952	-0.0001873	-0.0000522	0.0000154	0.0029054	-0.0011888	0.0007126
ipca.630	0.0061295	0.0073016	0.0084699	0.0096359	0.0108004	0.0119639	-0.0000011	-0.0000021	-0.0000003	0.0000147	0.0000385	0.0000636	0.0000900	0.0001125	0.0001542	0.0001790	0.0001103	-0.0002097	-0.0000573	0.0000172	0.0036475	-0.0017331	0.0005951
ipca.756	0.0075833	0.0090240	0.0104599	0.0118930	0.0133243	0.0147544	-0.0000011	-0.0000020	0.0000008	0.0000197	0.0000489	0.0000800	0.0001131	0.0001418	0.0001961	0.0002301	0.0001438	-0.0002260	-0.0000618	0.0000189	0.0044715	-0.0023380	0.0004686
ipca.1008	0.0099133	0.0117839	0.0136480	0.0155084	0.0173665	0.0192232	-0.0000003	0.0000007	0.0000064	0.0000320	0.0000682	0.0001064	0.0001481	0.0001852	0.0002597	0.0003128	0.0002452	-0.0002255	-0.0000602	0.0000205	0.0058530	-0.0034111	0.0002027
ipca.1260	0.0117326	0.0139426	0.0161447	0.0183423	0.0205373	0.0227305	0.0000011	0.0000046	0.0000136	0.0000444	0.0000840	0.0001252	0.0001714	0.0002138	0.0003040	0.0003761	0.0003715	-0.0002079	-0.0000500	0.0000209	0.0070050	-0.0042922	0.0000032
ipca.2520	0.0197076	0.0234593	0.0271959	0.0309243	0.0346476	0.0383679	0.0000023	0.0000077	0.0000178	0.0000489	0.0000919	0.0001427	0.0002060	0.0002716	0.0004290	0.0005821	0.0008272	-0.0002135	0.0000069	0.0000240	0.0122119	-0.0074998	-0.0003566

Tabela 6 – Matriz de Fatores de Risco – Partição E

	pre.21	pre.63	pre.126	pre.252	pre.378	pre.504	pre.630	pre.756	pre.1008	pre.1260	pre.2520	pre.3780	igpm.63	igpm.126	igpm.252	igpm.378	igpm.504	igpm.630	igpm.756	igpm.1008
ipca.3780	0.0000359	0.0001658	0.0005167	0.0016362	0.0030220	0.0044840	0.0059374	0.0074346	0.0101043	0.0124077	0.0214686	0.0285305	-0.0009271	-0.0009627	0.0001048	0.0017001	0.0031993	0.0043797	0.0054234	0.0069198
ipca.5040	0.0000451	0.0002057	0.0006382	0.0020270	0.0037662	0.0056092	0.0074403	0.0093213	0.0126609	0.0155287	0.0267810	0.0355870	-0.0012512	-0.0013974	-0.0001151	0.0018977	0.0037915	0.0052755	0.0065713	0.0084042
ipca.6300	0.0000571	0.0002535	0.0007681	0.0024042	0.0044595	0.0066408	0.0088038	0.0110187	0.0149309	0.0182734	0.0313375	0.0415325	-0.0014359	-0.0016697	-0.0002382	0.0020996	0.0043283	0.0060893	0.0076254	0.0097844
ipca.7560	0.0000768	0.0003274	0.0009608	0.0029372	0.0054198	0.0080605	0.0106778	0.0133534	0.0180651	0.0220796	0.0377279	0.0498318	-0.0016170	-0.0019168	-0.0002611	0.0025140	0.0052079	0.0073673	0.0092628	0.0119307
ipca.8820	0.0000964	0.0003949	0.0011246	0.0033565	0.0061596	0.0091528	0.0121248	0.0151640	0.0205154	0.0250769	0.0428483	0.0564146	-0.0016956	-0.0020164	-0.0001850	0.0029219	0.0059890	0.0084823	0.0106901	0.0138177
ipca.10080	0.0001125	0.0004456	0.0012395	0.0036279	0.0066306	0.0098543	0.0130666	0.0163581	0.0221686	0.0271364	0.0465195	0.0610866	-0.0017180	-0.0020251	-0.0000598	0.0032756	0.0066072	0.0093437	0.0117860	0.0152756
ipca.11340	0.0001264	0.0004886	0.0013370	0.0038604	0.0070407	0.0104758	0.0139149	0.0174492	0.0237154	0.0290981	0.0501555	0.0657222	-0.0017685	-0.0020517	0.0000692	0.0036399	0.0072271	0.0101906	0.0128513	0.0166858
ipca.12600	0.0001381	0.0005244	0.0014209	0.0040697	0.0074199	0.0110607	0.0147240	0.0185017	0.0252342	0.0310492	0.0538664	0.0704615	-0.0018582	-0.0021164	0.0001838	0.0040063	0.0078488	0.0110290	0.0138954	0.0180589
tr.63	0.0000015	0.0000046	0.0000099	0.0000199	0.0000280	0.0000349	0.0000411	0.0000474	0.0000577	0.0000658	0.0000921	0.0001082	0.0000105	0.0000177	0.0000300	0.0000381	0.0000434	0.0000473	0.0000520	0.0000598
tr.126	0.0000028	0.0000094	0.0000215	0.0000476	0.0000703	0.0000900	0.0001077	0.0001255	0.0001551	0.0001791	0.0002625	0.0003179	0.0000162	0.0000308	0.0000600	0.0000818	0.0000977	0.0001092	0.0001218	0.0001417
tr.252	0.0000048	0.0000173	0.0000432	0.0001066	0.0001673	0.0002220	0.0002719	0.0003220	0.0004066	0.0004762	0.0007251	0.0008938	0.0000073	0.0000322	0.0000962	0.0001520	0.0001956	0.0002282	0.0002609	0.0003108
tr.378	0.0000062	0.0000234	0.0000614	0.0001611	0.0002630	0.0003580	0.0004461	0.0005347	0.0006857	0.0008111	0.0012685	0.0015860	-0.0000202	0.0000089	0.0001046	0.0001967	0.0002716	0.0003283	0.0003832	0.0004666
tr.504	0.0000072	0.0000279	0.0000755	0.0002069	0.0003474	0.0004820	0.0006085	0.0007360	0.0009552	0.0011386	0.0018206	0.0023067	-0.0000555	-0.0000268	0.0000960	0.0002232	0.0003291	0.0004101	0.0004867	0.0006030
tr.630	0.0000083	0.0000328	0.0000905	0.0002561	0.0004393	0.0006184	0.0007887	0.0009607	0.0012585	0.0015094	0.0024576	0.0031492	-0.0000958	-0.0000687	0.0000839	0.0002513	0.0003929	0.0005018	0.0006034	0.0007570
tr.756	0.0000094	0.0000372	0.0001043	0.0003021	0.0005268	0.0007500	0.0009639	0.0011808	0.0015584	0.0018783	0.0031035	0.0040137	-0.0001367	-0.0001129	0.0000688	0.0002767	0.0004544	0.0005915	0.0007180	0.0009090
tr.1008	0.0000113	0.0000454	0.0001297	0.0003876	0.0006912	0.0009996	0.0012992	0.0016045	0.0021410	0.0025995	0.0043899	0.0057532	-0.0002148	-0.0001991	0.0000395	0.0003284	0.0005781	0.0007711	0.0009468	0.0012114
tr.1260	0.0000126	0.0000507	0.0001464	0.0004458	0.0008060	0.0011771	0.0015407	0.0019130	0.0025719	0.0031388	0.0053813	0.0071148	-0.0002714	-0.0002640	0.0000174	0.0003689	0.0006740	0.0009097	0.0011227	0.0014428
tr.2520	0.0000226	0.0000928	0.0002741	0.0008555	0.0015749	0.0023330	0.0030897	0.0038741	0.0052886	0.0065288	0.0115857	0.0156143	-0.0005495	-0.0005637	0.0000211	0.0007756	0.0014291	0.0019298	0.0023789	0.0030507
tr.3780	0.0000317	0.0001335	0.0003980	0.0012425	0.0022847	0.0033846	0.0044864	0.0056332	0.0077157	0.0095563	0.0171595	0.0232813	-0.0007559	-0.0007759	0.0000968	0.0012193	0.0021878	0.0029260	0.0035879	0.0045749
tr.5040	0.0000408	0.0001742	0.0005222	0.0016276	0.0029857	0.0044167	0.0058511	0.0073466	0.0100709	0.0124891	0.0225501	0.0306955	-0.0009467	-0.0009668	0.0001894	0.0016715	0.0029476	0.0039171	0.0047864	0.0060789
tr.6300	0.0000497	0.0002146	0.0006456	0.0020102	0.0036805	0.0054377	0.0071989	0.0090368	0.0123907	0.0153754	0.0278492	0.0379818	-0.0011324	-0.0011505	0.0002860	0.0021234	0.0037036	0.0049016	0.0059756	0.0075693
tr.7560	0.0000586	0.0002548	0.0007686	0.0023910	0.0043717	0.0064526	0.0085380	0.0107154	0.0146933	0.0182394	0.0331041	0.0452056	-0.0013165	-0.0013319	0.0003833	0.0025737	0.0044560	0.0058812	0.0071587	0.0090514
tr.8820	0.0000675	0.0002949	0.0008911	0.0027707	0.0050607	0.0074642	0.0098725	0.0123881	0.0169873	0.0210923	0.0383370	0.0523982	-0.0015000	-0.0015126	0.0004802	0.0030223	0.0052059	0.0068574	0.0083377	0.0105283
tr.10080	0.0000764	0.0003349	0.0010135	0.0031497	0.0057484	0.0084740	0.0112046	0.0140575	0.0192768	0.0239394	0.0435583	0.0595741	-0.0016833	-0.0016931	0.0005766	0.0034698	0.0059540	0.0078314	0.0095140	0.0120021
tr.11340	0.0000853	0.0003749	0.0011356	0.0035282	0.0064354	0.0094826	0.0125351	0.0157251	0.0215637	0.0267832	0.0487729	0.0667404	-0.0018666	-0.0018737	0.0006726	0.0039164	0.0067008	0.0088039	0.0106887	0.0134739
tr.12600	0.0000941	0.0004148	0.0012577	0.0039064	0.0071218	0.0104904	0.0138647	0.0173915	0.0238490	0.0296249	0.0539833	0.0739006	-0.0020499	-0.0020543	0.0007683	0.0043624	0.0074468	0.0097754	0.0118621	0.0149442
dolar.30	0.0000001	0.0000002	0.0000005	0.0000006	0.0000003	-0.0000003	-0.0000010	-0.0000016	-0.0000027	-0.0000037	-0.0000104	-0.0000186	-0.0000015	-0.0000012	-0.0000003	0.0000000	0.0000003	0.0000008	0.0000013	0.0000018
dolar.90	0.0000002	0.0000007	0.0000014	0.0000018	0.0000009	-0.0000007	-0.0000025	-0.0000043	-0.0000072	-0.0000099	-0.0000283	-0.0000509	-0.0000037	-0.0000030	-0.0000009	-0.0000004	0.0000007	0.0000022	0.0000038	0.0000057
dolar.180	0.0000003	0.0000013	0.0000026	0.0000036	0.0000022	-0.0000005	-0.0000035	-0.0000064	-0.0000112	-0.0000154	-0.0000440	-0.0000801	-0.0000049	-0.0000042	-0.0000021	-0.0000020	0.0000001	0.0000035	0.0000070	0.0000119
dolar.360	0.0000006	0.0000023	0.0000048	0.0000075	0.0000067	0.0000038	0.0000002	-0.0000031	-0.0000081	-0.0000113	-0.0000318	-0.0000613	-0.0000010	-0.0000023	-0.0000061	-0.0000090	-0.0000051	0.0000027	0.0000114	0.0000250
dolar.540	0.0000009	0.0000032	0.0000067	0.0000115	0.0000127	0.0000115	0.0000095	0.0000078	0.0000065	0.0000082	0.0000259	0.0000398	0.0000075	0.0000026	-0.0000116	-0.0000192	-0.0000139	-0.0000016	0.0000122	0.0000358
dolar.720	0.0000011	0.0000040	0.0000085	0.0000154	0.0000189	0.0000201	0.0000204	0.0000211	0.0000249	0.0000329	0.0000990	0.0001697	0.0000156	0.0000071	-0.0000182	-0.0000307	-0.0000244	-0.0000082	0.0000103	0.0000436
dolar.900	0.0000014	0.0000050	0.0000107	0.0000196	0.0000252	0.0000287	0.0000314	0.0000346	0.0000438	0.0000581	0.0001732	0.0003023	0.0000220	0.0000101	-0.0000269	-0.0000447	-0.0000374	-0.0000171	0.0000065	0.0000509
dolar.1080	0.0000018	0.0000061	0.0000128	0.0000228	0.0000296	0.0000350	0.0000396	0.0000450	0.0000587	0.0000780	0.0002304	0.0004040	0.0000256	0.0000108	-0.0000367	-0.0000594	-0.0000515	-0.0000275	0.0000006	0.0000550
dolar.1440	0.0000026	0.0000086	0.0000171	0.0000268	0.0000333	0.0000400	0.0000472	0.0000556	0.0000748	0.0000990	0.0002784	0.0004807	0.0000268	0.0000069	-0.0000620	-0.0000958	-0.0000869	-0.0000551	-0.0000172	0.0000589
dolar.1800	0.0000034	0.0000107	0.0000194	0.0000234	0.0000240	0.0000283	0.0000350	0.0000432	0.0000604	0.0000785	0.0001756	0.0002643	0.0000210	-0.0000028	-0.0000895	-0.0001334	-0.0001248	-0.0000872	-0.0000418	0.0000515
dolar.3600	0.0000029	0.0000073	-0.0000062	-0.0000784	-0.0001432	-0.0001793	-0.0001988	-0.0002182	-0.0002784	-0.0003969	-0.0018884	-0.0040214	-0.0000242	-0.0000783	-0.0001894	-0.0002452	-0.0002420	-0.0002052	-0.0001634	-0.0000785
igpm	-0.0000057	-0.0000214	-0.0000526	-0.0001137	-0.0001519	-0.0001739	-0.0001892	-0.0002053	-0.0002340	-0.0002635	-0.0004573	-0.0006906	-0.0001154	-0.0001554	-0.0001870	-0.0002111	-0.0002388	-0.0002637	-0.0002926	-0.0003336
ipca	-0.0000015	-0.0000060	-0.0000153	-0.0000325	-0.0000451	-0.0000554	-0.0000650	-0.0000752	-0.0000935	-0.0001107	-0.0002136	-0.0003356	-0.0000251	-0.0000307	-0.0000245	-0.0000161	-0.0000111	-0.0000093	-0.0000099	-0.0000150
tr	0.0000001	0.0000009	0.0000031	0.0000086	0.0000131	0.0000164	0.0000189	0.0000211	0.0000238	0.0000251	0.0000252	0.0000235	-0.0000049	-0.0000059	-0.0000053	-0.0000038	-0.0000026	-0.0000017	-0.0000012	-0.0000003
ibovespa	0.0000437	0.0001438	0.0003335	0.0008263	0.0014729	0.0022316	0.0030480	0.0039382	0.0056776	0.0073572	0.0153426	0.0221521	0.0001737	0.0002484	0.0010899	0.0020888	0.0029464	0.0036130	0.0042607	0.0052745
dolar	-0.0000104	-0.0000179	-0.0000315	-0.0001533	-0.0004536	-0.0008734	-0.0013407	-0.0018395	-0.0027911	-0.0036908	-0.0082058	-0.0124935	0.0002708	0.0005188	0.0004880	0.0001659	-0.0002700	-0.0007180	-0.0011616	-0.0019218
commodity	-0.0000281	-0.0000713	-0.0000931	-0.0001182	-0.0002101	-0.0003190	-0.0003940	-0.0004272	-0.0003641	-0.0001882	0.0013765	0.0031113	0.0010141	0.0013175	0.0013725	0.0011532	0.0009756	0.0009221	0.0010017	0.0012917

Tabela 7 – Matriz de Fatores de Risco – Partição F

	igpm.1260	igpm.2520	igpm.3780	igpm.5040	igpm.6300	igpm.7560	igpm.8820	igpm.10080	igpm.11340	igpm.12600	ipca.63	ipca.126	ipca.252	ipca.378	ipca.504	ipca.630	ipca.756	ipca.1008	ipca.1260	ipca.2520
ipca.3780	0.0083767	0.0177960	0.0268461	0.0348963	0.0423153	0.0493669	0.0562187	0.0629675	0.0696657	0.0763405	0.0004632	0.0003000	0.0012564	0.0028559	0.0044264	0.0057149	0.0071240	0.0095000	0.0115038	0.0212651
ipca.5040	0.0101605	0.0214646	0.0323497	0.0420201	0.0509173	0.0593662	0.0675729	0.0756558	0.0836785	0.0916735	0.0006413	0.0003880	0.0015247	0.0035309	0.0055300	0.0071769	0.0089668	0.0119661	0.0144832	0.0271438
ipca.6300	0.0118162	0.0247116	0.0371106	0.0481095	0.0582140	0.0678030	0.0771160	0.0862892	0.0953954	0.1044715	0.0008421	0.0005295	0.0018546	0.0042530	0.0066809	0.0087012	0.0108970	0.0145624	0.0176038	0.0327095
ipca.7560	0.0144132	0.0299623	0.0448599	0.0580452	0.0701404	0.0816119	0.0927520	0.1037261	0.1146214	0.1254823	0.0010864	0.0007328	0.0023671	0.0053343	0.0083736	0.0109251	0.0137037	0.0183327	0.0221357	0.0405318
ipca.8820	0.0167211	0.0347844	0.0520198	0.0672302	0.0811631	0.0943706	0.1071950	0.1198288	0.1323730	0.1448786	0.0012379	0.0008987	0.0028207	0.0062727	0.0098318	0.0128347	0.0161084	0.0215523	0.0259936	0.0469506
ipca.10080	0.0185310	0.0387841	0.0580366	0.0749749	0.0904709	0.1051535	0.1194084	0.1334512	0.1473946	0.1612955	0.0012646	0.0009876	0.0031461	0.0069553	0.0108907	0.0142146	0.0178367	0.0238453	0.0287245	0.0513325
ipca.11340	0.0202959	0.0428623	0.0642472	0.0830075	0.1001526	0.1163917	0.1321556	0.1476841	0.1631025	0.1784738	0.0012140	0.0010223	0.0034139	0.0075532	0.0118244	0.0154254	0.0193425	0.0258199	0.0310628	0.0550810
ipca.12600	0.0220220	0.0469731	0.0705594	0.0911988	0.1100458	0.1278919	0.1452137	0.1622756	0.1792158	0.1961038	0.0011085	0.0010136	0.0036330	0.0080827	0.0126602	0.0165054	0.0206764	0.0275489	0.0330981	0.0583657
tr.63	0.0000697	0.0001352	0.0001882	0.0002303	0.0002669	0.0003007	0.0003333	0.0003654	0.0003973	0.0004293	0.0000061	0.0000121	0.0000261	0.0000381	0.0000475	0.0000541	0.0000621	0.0000741	0.0000830	0.0001207
tr.126	0.0001650	0.0003155	0.0004419	0.0005471	0.0006415	0.0007303	0.0008163	0.0009010	0.0009853	0.0010696	0.0000121	0.0000239	0.0000569	0.0000876	0.0001120	0.0001291	0.0001489	0.0001781	0.0001989	0.0002841
tr.252	0.0003656	0.0007110	0.0010078	0.0012607	0.0014905	0.0017080	0.0019191	0.0021272	0.0023342	0.0025409	0.0000213	0.0000403	0.0001114	0.0001853	0.0002462	0.0002898	0.0003385	0.0004104	0.0004613	0.0006623
tr.378	0.0005551	0.0011051	0.0015823	0.0019905	0.0023621	0.0027138	0.0030553	0.0033920	0.0037266	0.0040606	0.0000262	0.0000482	0.0001519	0.0002681	0.0003674	0.0004406	0.0005210	0.0006413	0.0007269	0.0010620
tr.504	0.0007237	0.0014675	0.0021164	0.0026720	0.0031775	0.0036558	0.0041200	0.0045775	0.0050322	0.0054859	0.0000275	0.0000507	0.0001796	0.0003329	0.0004681	0.0005703	0.0006816	0.0008501	0.0009711	0.0014436
tr.630	0.0009144	0.0018795	0.0027248	0.0034488	0.0041070	0.0047294	0.0053334	0.0059285	0.0065199	0.0071099	0.0000277	0.0000529	0.0002084	0.0004019	0.0005772	0.0007125	0.0008590	0.0010830	0.0012452	0.0018798
tr.756	0.0011029	0.0022896	0.0033325	0.0042258	0.0050375	0.0058046	0.0065488	0.0072820	0.0080105	0.0087373	0.0000265	0.0000538	0.0002335	0.0004654	0.0006801	0.0008484	0.0010300	0.0013099	0.0015142	0.0023163
tr.1008	0.0014775	0.0031057	0.0045445	0.0057768	0.0068956	0.0079524	0.0089771	0.0099866	0.0109894	0.0119897	0.0000224	0.0000546	0.0002789	0.0005836	0.0008743	0.0011071	0.0013575	0.0017480	0.0020367	0.0031826
tr.1260	0.0017638	0.0037324	0.0054779	0.0069731	0.0083296	0.0096104	0.0108523	0.0120755	0.0132904	0.0145023	0.0000175	0.0000532	0.0003072	0.0006638	0.0010103	0.0012912	0.0015929	0.0020672	0.0024216	0.0038443
tr.2520	0.0037279	0.0079381	0.0116932	0.0149058	0.0178169	0.0205641	0.0232271	0.0258497	0.0284544	0.0310524	0.0000230	0.0000767	0.0005595	0.0012753	0.0019835	0.0025644	0.0031873	0.0041827	0.0049466	0.0081512
tr.3780	0.0055752	0.0118507	0.0174609	0.0222576	0.0266021	0.0307016	0.0346753	0.0385888	0.0424756	0.0463524	0.0000646	0.0001093	0.0008173	0.0018777	0.0029168	0.0037634	0.0046712	0.0061259	0.0072533	0.0120909
tr.5040	0.0073930	0.0156834	0.0231071	0.0294526	0.0351989	0.0406207	0.0458763	0.0510522	0.0561930	0.0613205	0.0001232	0.0001450	0.0010792	0.0024841	0.0038476	0.0049513	0.0061344	0.0080308	0.0095074	0.0159272
tr.6300	0.0091926	0.0194708	0.0286845	0.0365591	0.0436893	0.0504166	0.0569379	0.0633603	0.0697392	0.0761017	0.0001875	0.0001816	0.0013408	0.0030886	0.0047729	0.0061295	0.0075833	0.0099133	0.0117326	0.0197076
tr.7560	0.0109815	0.0232336	0.0342248	0.0436178	0.0521222	0.0601462	0.0679243	0.0755846	0.0831931	0.0907820	0.0002532	0.0002182	0.0016017	0.0036907	0.0056939	0.0073016	0.0090240	0.0117839	0.0139426	0.0234593
tr.8820	0.0127643	0.0269826	0.0397446	0.0506501	0.0605235	0.0698390	0.0788692	0.0877627	0.0965961	0.1054068	0.0003190	0.0002548	0.0018618	0.0042911	0.0066121	0.0084699	0.0104599	0.0136480	0.0161447	0.0271959
tr.10080	0.0145433	0.0307236	0.0452522	0.0576669	0.0689063	0.0795106	0.0897900	0.0999140	0.1099695	0.1199993	0.0003845	0.0002914	0.0021214	0.0048903	0.0075285	0.0096359	0.0118930	0.0155084	0.0183423	0.0309243
tr.11340	0.0163198	0.0344594	0.0507523	0.0646741	0.0772776	0.0891688	0.1006958	0.1120486	0.1233246	0.1345717	0.0004498	0.0003278	0.0023807	0.0054886	0.0084436	0.0108004	0.0133243	0.0173665	0.0205373	0.0346476
tr.12600	0.0180946	0.0381919	0.0562475	0.0716750	0.0856414	0.0988184	0.1115918	0.1241722	0.1366677	0.1491310	0.0005149	0.0003643	0.0026397	0.0060864	0.0093579	0.0119639	0.0147544	0.0192232	0.0227305	0.0383679
dolar.30	0.0000018	0.0000032	0.0000096	0.0000175	0.0000252	0.0000325	0.0000394	0.0000461	0.0000527	0.0000591	0.0000013	0.0000011	0.0000008	0.0000000	-0.0000008	-0.0000011	-0.0000011	-0.0000003	0.0000011	0.0000023
dolar.90	0.0000063	0.0000110	0.0000290	0.0000505	0.0000714	0.0000911	0.0001098	0.0001280	0.0001458	0.0001633	0.0000040	0.0000032	0.0000025	0.0000005	-0.0000014	-0.0000021	-0.0000020	0.0000007	0.0000046	0.0000077
dolar.180	0.0000143	0.0000263	0.0000572	0.0000928	0.0001268	0.0001587	0.0001891	0.0002185	0.0002474	0.0002758	0.0000084	0.0000062	0.0000050	0.0000024	0.0000003	-0.0000003	0.0000008	0.0000064	0.0000136	0.0000178
dolar.360	0.0000340	0.0000705	0.0001173	0.0001634	0.0002051	0.0002433	0.0002795	0.0003146	0.0003492	0.0003834	0.0000173	0.0000116	0.0000103	0.0000104	0.0000119	0.0000147	0.0000197	0.0000320	0.0000444	0.0000489
dolar.540	0.0000537	0.0001258	0.0001835	0.0002274	0.0002626	0.0002932	0.0003218	0.0003496	0.0003772	0.0004048	0.0000242	0.0000156	0.0000152	0.0000213	0.0000299	0.0000385	0.0000489	0.0000682	0.0000840	0.0000919
dolar.720	0.0000712	0.0001861	0.0002590	0.0003018	0.0003303	0.0003528	0.0003732	0.0003931	0.0004131	0.0004334	0.0000296	0.0000189	0.0000195	0.0000321	0.0000486	0.0000636	0.0000800	0.0001064	0.0001252	0.0001427
dolar.900	0.0000894	0.0002573	0.0003559	0.0004057	0.0004340	0.0004539	0.0004711	0.0004879	0.0005051	0.0005229	0.0000362	0.0000229	0.0000241	0.0000432	0.0000681	0.0000900	0.0001131	0.0001481	0.0001714	0.0002060
dolar.1080	0.0001038	0.0003256	0.0004555	0.0005184	0.0005520	0.0005741	0.0005926	0.0006106	0.0006291	0.0006484	0.0000429	0.0000269	0.0000281	0.0000524	0.0000843	0.0001125	0.0001418	0.0001852	0.0002138	0.0002716
dolar.1440	0.0001295	0.0004714	0.0006841	0.0007912	0.0008496	0.0008884	0.0009203	0.0009507	0.0009817	0.0010137	0.0000634	0.0000381	0.0000369	0.0000694	0.0001140	0.0001542	0.0001961	0.0002597	0.0003040	0.0004290
dolar.1800	0.0001389	0.0005778	0.0008680	0.0010211	0.0011069	0.0011638	0.0012099	0.0012530	0.0012962	0.0013405	0.0000906	0.0000517	0.0000454	0.0000808	0.0001316	0.0001790	0.0002301	0.0003128	0.0003761	0.0005821
dolar.3600	-0.0000099	0.0002878	0.0004856	0.0005568	0.0005441	0.0004869	0.0004099	0.0003259	0.0002408	0.0001571	0.0002218	0.0001127	0.0000867	0.0000883	0.0000952	0.0001103	0.0001438	0.0002452	0.0003715	0.0008272
igpm	-0.0003768	-0.0006408	-0.0008541	-0.0010231	-0.0011700	-0.0013073	-0.0014410	-0.0015738	-0.0017067	-0.0018402	0.0000239	0.0000010	-0.0000675	-0.0001387	-0.0001873	-0.0002097	-0.0002260	-0.0002255	-0.0002079	-0.0002135
ipca	-0.0000229	-0.0000716	-0.0000983	-0.0001060	-0.0001045	-0.0000993	-0.0000929	-0.0000862	-0.0000796	-0.0000734	-0.0000030	-0.0000176	-0.0000325	-0.0000432	-0.0000522	-0.0000573	-0.0000618	-0.0000602	-0.0000500	0.0000069
tr	0.0000009	0.0000145	0.0000329	0.0000516	0.0000700	0.0000881	0.0001059	0.0001235	0.0001408	0.0001581	-0.0000006	0.0000019	0.0000073	0.0000121	0.0000154	0.0000172	0.0000189	0.0000205	0.0000209	0.0000240
ibovespa	0.0063810	0.0137188	0.0203510	0.0260164	0.0311732	0.0360696	0.0408383	0.0455480	0.0502330	0.0549098	0.0004419	0.0003215	0.0009749	0.0019735	0.0029054	0.0036475	0.0044715	0.0058530	0.0070050	0.0122119
dolar	-0.0026425	-0.0064239	-0.0092636	-0.0114239	-0.0133123	-0.0150990	-0.0168516	-0.0185965	-0.0203433	-0.0220951	-0.0004035	-0.0001334	-0.0001774	-0.0006214	-0.0011888	-0.0017331	-0.0023380	-0.0034111	-0.0042922	-0.0074998
commodity	0.0016535	0.0029033	0.0029555	0.0026279	0.0022344	0.0018518	0.0014948	0.0011624	0.0008503	0.0005547	0.0004757	0.0002609	0.0005153	0.0007117	0.0007126	0.0005951	0.0004686	0.0002027	0.0000032	-0.0003566

Tabela 8 – Matriz de Fatores de Risco – Partição G

	ipca.3780	ipca.5040	ipca.6300	ipca.7560	ipca.8820	ipca.10080	ipca.11340	ipca.12600	tr.63	tr.126	tr.252	tr.378	tr.504	tr.630	tr.756	tr.1008	tr.1260	tr.2520	tr.3780	tr.5040
ipca.3780	0.0307220	0.0404098	0.0490696	0.0605037	0.0693602	0.0749512	0.0795449	0.0834872	0.0001571	0.0003648	0.0008484	0.0013696	0.0018758	0.0024590	0.0030477	0.0042270	0.0051426	0.0111055	0.0165812	0.0219105
ipca.5040	0.0404098	0.0546168	0.0675601	0.0841411	0.0967910	0.1044936	0.1105052	0.1154215	0.0002038	0.0004673	0.0010745	0.0017282	0.0023655	0.0031028	0.0038497	0.0053522	0.0065260	0.0141713	0.0211892	0.0280141
ipca.6300	0.0490696	0.0675601	0.0853388	0.1083019	0.1264642	0.1380344	0.1470779	0.1543701	0.0002578	0.0005825	0.0013116	0.0020840	0.0028336	0.0037035	0.0045864	0.0063674	0.0077619	0.0168537	0.0251823	0.0332742
ipca.7560	0.0605037	0.0841411	0.1083019	0.1404224	0.1673417	0.1858961	0.2009670	0.2134016	0.0003382	0.0007527	0.0016546	0.0025886	0.0034879	0.0045351	0.0055998	0.0077540	0.0094435	0.0204806	0.0305726	0.0403694
ipca.8820	0.0693602	0.0967910	0.1264642	0.1673417	0.2036604	0.2306472	0.2535382	0.2730296	0.0004122	0.0009057	0.0019480	0.0030033	0.0040118	0.0051909	0.0063922	0.0088313	0.0107491	0.0233077	0.0347802	0.0459099
ipca.10080	0.0749512	0.1044936	0.1380344	0.1858961	0.2306472	0.2660055	0.2971302	0.3243886	0.0004682	0.0010195	0.0021565	0.0032862	0.0043597	0.0056202	0.0069079	0.0095323	0.0116028	0.0251935	0.0376086	0.0496475
ipca.11340	0.0795449	0.1105052	0.1470779	0.2009670	0.2535382	0.2971302	0.3366632	0.3720892	0.0005152	0.0011157	0.0023335	0.0035270	0.0046576	0.0059906	0.0073562	0.0101501	0.0123631	0.0269178	0.0402222	0.0531198
ipca.12600	0.0834872	0.1154215	0.1543701	0.2134016	0.2730296	0.3243886	0.3720892	0.4156335	0.0005535	0.0011959	0.0024848	0.0037367	0.0049215	0.0063237	0.0077645	0.0107226	0.0130754	0.0285719	0.0427517	0.0564956
tr.63	0.0001571	0.0002038	0.0002578	0.0003382	0.0004122	0.0004682	0.0005152	0.0005535	0.0000058	0.0000115	0.0000207	0.0000277	0.0000331	0.0000390	0.0000446	0.0000554	0.0000627	0.0001172	0.0001675	0.0002169
tr.126	0.0003648	0.0004673	0.0005825	0.0007527	0.0009057	0.0010195	0.0011157	0.0011959	0.0000115	0.0000234	0.0000436	0.0000595	0.0000717	0.0000853	0.0000981	0.0001225	0.0001393	0.0002626	0.0003767	0.0004887
tr.252	0.0008484	0.0010745	0.0013116	0.0016546	0.0019480	0.0021565	0.0023335	0.0024848	0.0000207	0.0000436	0.0000859	0.0001215	0.0001501	0.0001817	0.0002116	0.0002686	0.0003081	0.0005899	0.0008500	0.0011054
tr.378	0.0013696	0.0017282	0.0020840	0.0025886	0.0030033	0.0032862	0.0035270	0.0037367	0.0000277	0.0000595	0.0001215	0.0001768	0.0002232	0.0002744	0.0003233	0.0004162	0.0004815	0.0009337	0.0013488	0.0017557
tr.504	0.0018758	0.0023655	0.0028336	0.0034879	0.0040118	0.0043597	0.0046576	0.0049215	0.0000331	0.0000717	0.0001501	0.0002232	0.0002864	0.0003564	0.0004235	0.0005518	0.0006429	0.0012611	0.0018257	0.0023780
tr.630	0.0024590	0.0031028	0.0037035	0.0045351	0.0051909	0.0056202	0.0059906	0.0063237	0.0000390	0.0000853	0.0001817	0.0002744	0.0003564	0.0004475	0.0005355	0.0007045	0.0008257	0.0016365	0.0023738	0.0030937
tr.756	0.0030477	0.0038497	0.0045864	0.0055998	0.0063922	0.0069079	0.0073562	0.0077645	0.0000446	0.0000981	0.0002116	0.0003233	0.0004235	0.0005355	0.0006444	0.0008543	0.0010063	0.0020130	0.0029258	0.0038157
tr.1008	0.0042270	0.0053522	0.0063674	0.0077540	0.0088313	0.0095323	0.0101501	0.0107226	0.0000554	0.0001225	0.0002686	0.0004162	0.0005518	0.0007045	0.0008543	0.0011456	0.0013599	0.0027643	0.0040344	0.0052697
tr.1260	0.0051426	0.0065260	0.0077619	0.0094435	0.0107491	0.0116028	0.0123631	0.0130754	0.0000627	0.0001393	0.0003081	0.0004815	0.0006429	0.0008257	0.0010063	0.0013599	0.0016236	0.0033437	0.0049002	0.0064122
tr.2520	0.0111055	0.0141713	0.0168537	0.0204806	0.0233077	0.0251935	0.0269178	0.0285719	0.0001172	0.0002626	0.0005899	0.0009337	0.0012611	0.0016365	0.0020130	0.0027643	0.0033437	0.0071599	0.0106793	0.0141068
tr.3780	0.0165812	0.0211892	0.0251823	0.0305726	0.0347802	0.0376086	0.0402222	0.0427517	0.0001675	0.0003767	0.0008500	0.0013488	0.0018257	0.0023738	0.0029258	0.0040344	0.0049002	0.0106793	0.0161099	0.0214303
tr.5040	0.0219105	0.0280141	0.0332742	0.0403694	0.0459099	0.0496475	0.0531198	0.0564956	0.0002169	0.0004887	0.0011054	0.0017557	0.0023780	0.0030937	0.0038157	0.0052697	0.0064122	0.0141068	0.0214303	0.0286397
tr.6300	0.0271603	0.0347353	0.0412414	0.0500132	0.0568637	0.0614940	0.0658093	0.0700160	0.0002656	0.0005995	0.0013578	0.0021578	0.0029233	0.0038043	0.0046935	0.0064870	0.0079011	0.0174823	0.0266793	0.0357634
tr.7560	0.0323689	0.0414031	0.0491448	0.0595795	0.0677290	0.0732442	0.0783950	0.0834248	0.0003141	0.0007096	0.0016087	0.0025573	0.0034652	0.0045100	0.0055651	0.0076953	0.0093787	0.0208309	0.0318884	0.0428357
tr.8820	0.0375559	0.0480429	0.0570149	0.0691056	0.0785485	0.0849447	0.0909269	0.0967761	0.0003624	0.0008194	0.0018587	0.0029555	0.0040052	0.0052133	0.0064337	0.0088992	0.0108506	0.0241655	0.0370755	0.0498783
tr.10080	0.0427307	0.0546669	0.0648665	0.0786093	0.0893427	0.0966177	0.1034294	0.1100957	0.0004106	0.0009290	0.0021083	0.0033530	0.0045441	0.0059152	0.0073005	0.0101006	0.0123195	0.0274924	0.0422499	0.0569033
tr.11340	0.0478984	0.0612817	0.0727072	0.0880999	0.1001221	0.1082747	0.1159145	0.1233966	0.0004588	0.0010384	0.0023577	0.0037500	0.0050825	0.0066164	0.0081664	0.0113007	0.0137866	0.0308147	0.0474165	0.0639173
tr.12600	0.0530614	0.0678905	0.0805408	0.0975821	0.1108919	0.1199214	0.1283886	0.1366857	0.0005070	0.0011478	0.0026069	0.0041468	0.0056205	0.0073171	0.0090317	0.0124999	0.0152526	0.0341341	0.0525781	0.0709240
dolar.30	-0.0000051	-0.0000113	-0.0000132	-0.0000141	-0.0000152	-0.0000179	-0.0000229	-0.0000296	0.0000001	0.0000001	0.0000002	0.0000002	0.0000000	-0.0000002	-0.0000005	-0.0000011	-0.0000016	-0.0000040	-0.0000058	-0.0000075
dolar.90	-0.0000147	-0.0000324	-0.0000374	-0.0000390	-0.0000414	-0.0000493	-0.0000643	-0.0000848	0.0000002	0.0000005	0.0000008	0.0000007	0.0000002	-0.0000005	-0.0000013	-0.0000029	-0.0000044	-0.0000112	-0.0000163	-0.0000209
dolar.180	-0.0000242	-0.0000558	-0.0000620	-0.0000606	-0.0000615	-0.0000745	-0.0001022	-0.0001415	0.0000005	0.0000012	0.0000020	0.0000020	0.0000012	0.0000001	-0.0000012	-0.0000040	-0.0000064	-0.0000175	-0.0000255	-0.0000326
dolar.360	-0.0000181	-0.0000611	-0.0000557	-0.0000303	-0.0000108	-0.0000181	-0.0000552	-0.0001158	0.0000015	0.0000033	0.0000058	0.0000066	0.0000062	0.0000052	0.0000040	0.0000011	-0.0000016	-0.0000104	-0.0000138	-0.0000156
dolar.540	0.0000234	-0.0000089	0.0000231	0.0000923	0.0001543	0.0001770	0.0001590	0.0001080	0.0000028	0.0000058	0.0000105	0.0000129	0.0000135	0.0000138	0.0000137	0.0000131	0.0000121	0.0000183	0.0000316	0.0000469
dolar.720	0.0000876	0.0000777	0.0001441	0.0002690	0.0003889	0.0004604	0.0004844	0.0004679	0.0000041	0.0000084	0.0000152	0.0000192	0.0000212	0.0000230	0.0000244	0.0000269	0.0000284	0.0000543	0.0000890	0.0001261
dolar.900	0.0001695	0.0001868	0.0002947	0.0004896	0.0006856	0.0008246	0.0009096	0.0009460	0.0000055	0.0000111	0.0000200	0.0000257	0.0000288	0.0000322	0.0000351	0.0000406	0.0000445	0.0000910	0.0001485	0.0002090
dolar.1080	0.0002575	0.0003033	0.0004540	0.0007236	0.0010042	0.0012222	0.0013815	0.0014851	0.0000068	0.0000134	0.0000238	0.0000306	0.0000346	0.0000390	0.0000429	0.0000507	0.0000565	0.0001197	0.0001964	0.0002764
dolar.1440	0.0004589	0.0005607	0.0008097	0.0012608	0.0017537	0.0021734	0.0025231	0.0027982	0.0000090	0.0000173	0.0000298	0.0000375	0.0000420	0.0000470	0.0000516	0.0000611	0.0000685	0.0001523	0.0002556	0.0003635
dolar.1800	0.0006450	0.0007873	0.0011266	0.0017576	0.0024700	0.0031032	0.0036556	0.0041132	0.0000104	0.0000191	0.0000309	0.0000371	0.0000399	0.0000430	0.0000458	0.0000518	0.0000569	0.0001324	0.0002333	0.0003397
dolar.3600	0.0007894	0.0007894	0.0011163	0.0018868	0.0028420	0.0037348	0.0045195	0.0051619	0.0000081	0.0000080	0.0000003	-0.0000131	-0.0000297	-0.0000494	-0.0000703	-0.0001123	-0.0001455	-0.0003309	-0.0004935	-0.0006527
igpm	-0.0003557	-0.0005071	-0.0006052	-0.0006974	-0.0007331	-0.0007259	-0.0007120	-0.0006994	-0.0000127	-0.0000263	-0.0000513	-0.0000723	-0.0000884	-0.0001054	-0.0001206	-0.0001480	-0.0001656	-0.0003092	-0.0004526	-0.0005957
ipca	0.0000144	0.0000013	0.0000006	0.0000241	0.0000670	0.0001152	0.0001605	0.0001988	-0.0000016	-0.0000044	-0.0000106	-0.0000167	-0.0000217	-0.0000269	-0.0000316	-0.0000399	-0.0000454	-0.0000868	-0.0001233	-0.0001556
tr	0.0000337	0.0000488	0.0000649	0.0000851	0.0001009	0.0001103	0.0001167	0.0001213	0.0000008	0.0000018	0.0000038	0.0000055	0.0000067	0.0000079	0.0000088	0.0000104	0.0000111	0.0000162	0.0000194	0.0000221
ibovespa	0.0166356	0.0209834	0.0249334	0.0306917	0.0357190	0.0396382	0.0434681	0.0472372	0.0001698	0.0003372	0.0006689	0.0010109	0.0013455	0.0017418	0.0021474	0.0029751	0.0036360	0.0081724	0.0125782	0.0169266
dolar	-0.0101243	-0.0136705	-0.0178927	-0.0238802	-0.0291845	-0.0329786	-0.0359798	-0.0383132	-0.0000654	-0.0001187	-0.0002268	-0.0003601	-0.0005122	-0.0007045	-0.0009127	-0.0013565	-0.0017311	-0.0041702	-0.0065182	-0.0088459
commodity	-0.0008037	-0.0017776	-0.0030303	-0.0044423	-0.0053280	-0.0054311	-0.0049403	-0.0039809	-0.0000814	-0.0001560	-0.0002696	-0.0003467	-0.0003945	-0.0004430	-0.0004808	-0.0005342	-0.0005398	-0.0006152	-0.0006638	-0.0007311

Tabela 9 – Matriz de Fatores de Risco – Partição H

	tr.6300	tr.7560	tr.8820	tr.10080	tr.11340	tr.12600	dolar.30	dolar.90	dolar.180	dolar.360	dolar.540	dolar.720	dolar.900	dolar.1080	dolar.1440	dolar.1800	dolar.3600	igpm	ipca	tr	ibovespa	dolar	commodity
ipca.3780	0.0271603	0.0323689	0.0375559	0.0427307	0.0478984	0.0530614	-0.0000051	-0.0000147	-0.0000242	-0.0000181	0.0000234	0.0000876	0.0001695	0.0002575	0.0004589	0.0006450	0.0007894	-0.0003557	0.0000144	0.0000337	0.0166356	-0.0101243	-0.0008037
ipca.5040	0.0347353	0.0414031	0.0480429	0.0546669	0.0612817	0.0678905	-0.0000113	-0.0000324	-0.0000558	-0.0000611	-0.0000089	0.0000777	0.0001868	0.0003033	0.0005607	0.0007873	0.0007894	-0.0005071	0.0000013	0.0000488	0.0209834	-0.0136705	-0.0017776
ipca.6300	0.0412414	0.0491448	0.0570149	0.0648665	0.0727072	0.0805408	-0.0000132	-0.0000374	-0.0000620	-0.0000557	0.0000231	0.0001441	0.0002947	0.0004540	0.0008097	0.0011266	0.0011163	-0.0006052	0.0000006	0.0000649	0.0249334	-0.0178927	-0.0030303
ipca.7560	0.0500132	0.0595795	0.0691056	0.0786093	0.0880999	0.0975821	-0.0000141	-0.0000390	-0.0000606	-0.0000303	0.0000923	0.0002690	0.0004896	0.0007236	0.0012608	0.0017576	0.0018868	-0.0006974	0.0000241	0.0000851	0.0306917	-0.0238802	-0.0044423
ipca.8820	0.0568637	0.0677290	0.0785485	0.0893427	0.1001221	0.1108919	-0.0000152	-0.0000414	-0.0000615	-0.0000108	0.0001543	0.0003889	0.0006856	0.0010042	0.0017537	0.0024700	0.0028420	-0.0007331	0.0000670	0.0001009	0.0357190	-0.0291845	-0.0053280
ipca.10080	0.0614940	0.0732442	0.0849447	0.0966177	0.1082747	0.1199214	-0.0000179	-0.0000493	-0.0000745	-0.0000181	0.0001770	0.0004604	0.0008246	0.0012222	0.0021734	0.0031032	0.0037348	-0.0007259	0.0001152	0.0001103	0.0396382	-0.0329786	-0.0054311
ipca.11340	0.0658093	0.0783950	0.0909269	0.1034294	0.1159145	0.1283886	-0.0000229	-0.0000643	-0.0001022	-0.0000552	0.0001590	0.0004844	0.0009096	0.0013815	0.0025231	0.0036556	0.0045195	-0.0007120	0.0001605	0.0001167	0.0434681	-0.0359798	-0.0049403
ipca.12600	0.0700160	0.0834248	0.0967761	0.1100957	0.1233966	0.1366857	-0.0000296	-0.0000848	-0.0001415	-0.0001158	0.0001080	0.0004679	0.0009460	0.0014851	0.0027982	0.0041132	0.0051619	-0.0006994	0.0001988	0.0001213	0.0472372	-0.0383132	-0.0039809
tr.63	0.0002656	0.0003141	0.0003624	0.0004106	0.0004588	0.0005070	0.0000001	0.0000002	0.0000005	0.0000015	0.0000028	0.0000041	0.0000055	0.0000068	0.0000090	0.0000104	0.0000081	-0.0000127	-0.0000016	0.0000008	0.0001698	-0.0000654	-0.0000814
tr.126	0.0005995	0.0007096	0.0008194	0.0009290	0.0010384	0.0011478	0.0000001	0.0000005	0.0000012	0.0000033	0.0000058	0.0000084	0.0000111	0.0000134	0.0000173	0.0000191	0.0000080	-0.0000263	-0.0000044	0.0000018	0.0003372	-0.0001187	-0.0001560
tr.252	0.0013578	0.0016087	0.0018587	0.0021083	0.0023577	0.0026069	0.0000002	0.0000008	0.0000020	0.0000058	0.0000105	0.0000152	0.0000200	0.0000238	0.0000298	0.0000309	0.0000003	-0.0000513	-0.0000106	0.0000038	0.0006689	-0.0002268	-0.0002696
tr.378	0.0021578	0.0025573	0.0029555	0.0033530	0.0037500	0.0041468	0.0000002	0.0000007	0.0000020	0.0000066	0.0000129	0.0000192	0.0000257	0.0000306	0.0000375	0.0000371	-0.0000131	-0.0000723	-0.0000167	0.0000055	0.0010109	-0.0003601	-0.0003467
tr.504	0.0029233	0.0034652	0.0040052	0.0045441	0.0050825	0.0056205	0.0000000	0.0000002	0.0000012	0.0000062	0.0000135	0.0000212	0.0000288	0.0000346	0.0000420	0.0000399	-0.0000297	-0.0000884	-0.0000217	0.0000067	0.0013455	-0.0005122	-0.0003945
tr.630	0.0038043	0.0045100	0.0052133	0.0059152	0.0066164	0.0073171	-0.0000002	-0.0000005	0.0000001	0.0000052	0.0000138	0.0000230	0.0000322	0.0000390	0.0000470	0.0000430	-0.0000494	-0.0001054	-0.0000269	0.0000079	0.0017418	-0.0007045	-0.0004430
tr.756	0.0046935	0.0055651	0.0064337	0.0073005	0.0081664	0.0090317	-0.0000005	-0.0000013	-0.0000012	0.0000040	0.0000137	0.0000244	0.0000351	0.0000429	0.0000516	0.0000458	-0.0000703	-0.0001206	-0.0000316	0.0000088	0.0021474	-0.0009127	-0.0004808
tr.1008	0.0064870	0.0076953	0.0088992	0.0101006	0.0113007	0.0124999	-0.0000011	-0.0000029	-0.0000040	0.0000011	0.0000131	0.0000269	0.0000406	0.0000507	0.0000611	0.0000518	-0.0001123	-0.0001480	-0.0000399	0.0000104	0.0029751	-0.0013565	-0.0005342
tr.1260	0.0079011	0.0093787	0.0108506	0.0123195	0.0137866	0.0152526	-0.0000016	-0.0000044	-0.0000064	-0.0000016	0.0000121	0.0000284	0.0000445	0.0000565	0.0000685	0.0000569	-0.0001455	-0.0001656	-0.0000454	0.0000111	0.0036360	-0.0017311	-0.0005398
tr.2520	0.0174823	0.0208309	0.0241655	0.0274924	0.0308147	0.0341341	-0.0000040	-0.0000112	-0.0000175	-0.0000104	0.0000183	0.0000543	0.0000910	0.0001197	0.0001523	0.0001324	-0.0003309	-0.0003092	-0.0000868	0.0000162	0.0081724	-0.0041702	-0.0006152
tr.3780	0.0266793	0.0318884	0.0370755	0.0422499	0.0474165	0.0525781	-0.0000058	-0.0000163	-0.0000255	-0.0000138	0.0000316	0.0000890	0.0001485	0.0001964	0.0002556	0.0002333	-0.0004935	-0.0004526	-0.0001233	0.0000194	0.0125782	-0.0065182	-0.0006638
tr.5040	0.0357634	0.0428357	0.0498783	0.0569033	0.0639173	0.0709240	-0.0000075	-0.0000209	-0.0000326	-0.0000156	0.0000469	0.0001261	0.0002090	0.0002764	0.0003635	0.0003397	-0.0006527	-0.0005957	-0.0001556	0.0000221	0.0169266	-0.0088459	-0.0007311
tr.6300	0.0447496	0.0536738	0.0625609	0.0714255	0.0802757	0.0891164	-0.0000091	-0.0000255	-0.0000395	-0.0000170	0.0000626	0.0001635	0.0002695	0.0003564	0.0004711	0.0004460	-0.0008104	-0.0007374	-0.0001855	0.0000246	0.0212216	-0.0111550	-0.0008029
tr.7560	0.0536738	0.0644394	0.0751608	0.0858548	0.0965312	0.1071957	-0.0000107	-0.0000300	-0.0000463	-0.0000184	0.0000783	0.0002006	0.0003296	0.0004358	0.0005781	0.0005516	-0.0009672	-0.0008781	-0.0002143	0.0000271	0.0254831	-0.0134507	-0.0008756
tr.8820	0.0625609	0.0751608	0.0877092	0.1002254	0.1127207	0.1252019	-0.0000123	-0.0000345	-0.0000531	-0.0000197	0.0000938	0.0002376	0.0003895	0.0005149	0.0006845	0.0006566	-0.0011235	-0.0010182	-0.0002427	0.0000295	0.0297252	-0.0157375	-0.0009486
tr.10080	0.0714255	0.0858548	0.1002254	0.1145590	0.1288684	0.1431615	-0.0000139	-0.0000389	-0.0000598	-0.0000211	0.0001094	0.0002744	0.0004491	0.0005936	0.0007904	0.0007612	-0.0012795	-0.0011580	-0.0002710	0.0000320	0.0339557	-0.0180184	-0.0010221
tr.11340	0.0802757	0.0965312	0.1127207	0.1288684	0.1449887	0.1610904	-0.0000155	-0.0000434	-0.0000666	-0.0000225	0.0001248	0.0003111	0.0005086	0.0006722	0.0008961	0.0008654	-0.0014353	-0.0012977	-0.0002993	0.0000344	0.0381789	-0.0202954	-0.0010960
tr.12600	0.0891164	0.1071957	0.1252019	0.1431615	0.1610904	0.1789984	-0.0000171	-0.0000479	-0.0000733	-0.0000239	0.0001402	0.0003478	0.0005680	0.0007507	0.0010017	0.0009695	-0.0015909	-0.0014372	-0.0003276	0.0000369	0.0423974	-0.0225695	-0.0011702
dolar.30	-0.0000091	-0.0000107	-0.0000123	-0.0000139	-0.0000155	-0.0000171	0.0000005	0.0000016	0.0000027	0.0000040	0.0000041	0.0000037	0.0000035	0.0000034	0.0000041	0.0000055	0.0000106	0.0000018	0.0000004	0.0000000	0.0000011	-0.0000066	-0.0000232
dolar.90	-0.0000255	-0.0000300	-0.0000345	-0.0000389	-0.0000434	-0.0000479	0.0000016	0.0000045	0.0000080	0.0000121	0.0000128	0.0000121	0.0000119	0.0000119	0.0000144	0.0000185	0.0000338	0.0000049	0.0000009	0.0000001	0.0000086	-0.0000267	-0.0000699
dolar.180	-0.0000395	-0.0000463	-0.0000531	-0.0000598	-0.0000666	-0.0000733	0.0000027	0.0000080	0.0000147	0.0000233	0.0000261	0.0000263	0.0000272	0.0000281	0.0000340	0.0000422	0.0000705	0.0000077	0.0000013	0.0000001	0.0000340	-0.0000730	-0.0001357
dolar.360	-0.0000170	-0.0000184	-0.0000197	-0.0000211	-0.0000225	-0.0000239	0.0000040	0.0000121	0.0000233	0.0000416	0.0000520	0.0000579	0.0000646	0.0000702	0.0000866	0.0001035	0.0001474	0.0000066	0.0000002	0.0000000	0.0001325	-0.0002113	-0.0002528
dolar.540	0.0000626	0.0000783	0.0000938	0.0001094	0.0001248	0.0001402	0.0000041	0.0000128	0.0000261	0.0000520	0.0000716	0.0000861	0.0001017	0.0001146	0.0001455	0.0001730	0.0002211	-0.0000005	-0.0000027	-0.0000002	0.0002594	-0.0003612	-0.0003417
dolar.720	0.0001635	0.0002006	0.0002376	0.0002744	0.0003111	0.0003478	0.0000037	0.0000121	0.0000263	0.0000579	0.0000861	0.0001098	0.0001351	0.0001567	0.0002055	0.0002470	0.0003009	-0.0000088	-0.0000063	-0.0000002	0.0003809	-0.0004925	-0.0004183
dolar.900	0.0002695	0.0003296	0.0003895	0.0004491	0.0005086	0.0005680	0.0000035	0.0000119	0.0000272	0.0000646	0.0001017	0.0001351	0.0001715	0.0002038	0.0002760	0.0003380	0.0004128	-0.0000164	-0.0000104	-0.0000003	0.0005015	-0.0006235	-0.0005142
dolar.1080	0.0003564	0.0004358	0.0005149	0.0005936	0.0006722	0.0007507	0.0000034	0.0000119	0.0000281	0.0000702	0.0001146	0.0001567	0.0002038	0.0002469	0.0003450	0.0004319	0.0005475	-0.0000215	-0.0000141	-0.0000003	0.0005948	-0.0007278	-0.0006103
dolar.1440	0.0004711	0.0005781	0.0006845	0.0007904	0.0008961	0.0010017	0.0000041	0.0000144	0.0000340	0.0000866	0.0001455	0.0002055	0.0002760	0.0003450	0.0005092	0.0006675	0.0009624	-0.0000239	-0.0000208	-0.0000005	0.0007539	-0.0009383	-0.0008651
dolar.1800	0.0004460	0.0005516	0.0006566	0.0007612	0.0008654	0.0009695	0.0000055	0.0000185	0.0000422	0.0001035	0.0001730	0.0002470	0.0003380	0.0004319	0.0006675	0.0009133	0.0015325	-0.0000130	-0.0000238	-0.0000010	0.0008368	-0.0011038	-0.0011370
dolar.3600	-0.0008104	-0.0009672	-0.0011235	-0.0012795	-0.0014353	-0.0015909	0.0000106	0.0000338	0.0000705	0.0001474	0.0002211	0.0003009	0.0004128	0.0005475	0.0009624	0.0015325	0.0046921	0.0001330	0.0000156	-0.0000092	0.0009884	-0.0015477	-0.0020679
igpm	-0.0007374	-0.0008781	-0.0010182	-0.0011580	-0.0012977	-0.0014372	0.0000018	0.0000049	0.0000077	0.0000066	-0.0000005	-0.0000088	-0.0000164	-0.0000215	-0.0000239	-0.0000130	0.0001330	0.0005462	0.0000895	-0.0000042	-0.0008968	-0.0001357	0.0006967
ipca	-0.0001855	-0.0002143	-0.0002427	-0.0002710	-0.0002993	-0.0003276	0.0000004	0.0000009	0.0000013	0.0000002	-0.0000027	-0.0000063	-0.0000104	-0.0000141	-0.0000208	-0.0000238	0.0000156	0.0000895	0.0000935	-0.0000047	-0.0001218	-0.0000787	0.0000335
tr	0.0000246	0.0000271	0.0000295	0.0000320	0.0000344	0.0000369	0.0000000	0.0000001	0.0000001	0.0000000	-0.0000002	-0.0000002	-0.0000003	-0.0000003	-0.0000005	-0.0000010	-0.0000092	-0.0000042	-0.0000047	0.0000041	-0.0000905	0.0000279	-0.0000145
ibovespa	0.0212216	0.0254831	0.0297252	0.0339557	0.0381789	0.0423974	0.0000011	0.0000086	0.0000340	0.0001325	0.0002594	0.0003809	0.0005015	0.0005948	0.0007539	0.0008368	0.0009884	-0.0008968	-0.0001218	-0.0000905	0.0456060	-0.0226435	0.0028619
dolar	-0.0111550	-0.0134507	-0.0157375	-0.0180184	-0.0202954	-0.0225695	-0.0000066	-0.0000267	-0.0000730	-0.0002113	-0.0003612	-0.0004925	-0.0006235	-0.0007278	-0.0009383	-0.0011038	-0.0015477	-0.0001357	-0.0000787	0.0000279	-0.0226435	0.0253317	-0.0001365
commodity	-0.0008029	-0.0008756	-0.0009486	-0.0010221	-0.0010960	-0.0011702	-0.0000232	-0.0000699	-0.0001357	-0.0002528	-0.0003417	-0.0004183	-0.0005142	-0.0006103	-0.0008651	-0.0011370	-0.0020679	0.0006967	0.0000335	-0.0000145	0.0028619	-0.0001365	0.0327313

b) $\mathbf{E}$: vetor das exposições líquidas (*EL*) no formato definido a seguir:

$$E = (\quad EL_{pré,1\ mês} \quad \cdots \quad EL_{pré,15\ anos} \quad EL_{IGPM,3\ meses} \quad \cdots \quad EL_{IGPM,50\ anos} \quad EL_{IPCA,3\ meses} \quad \cdots$$
$$EL_{IPCA,50\ anos} \quad EL_{TR,3\ meses} \quad \cdots \quad EL_{TR,50\ anos} \quad EL_{câmbio,1\ mês} \quad \cdots$$
$$EL_{câmbio,10\ anos} \quad EL_{IGPM} \quad EL_{IPCA} \quad EL_{TR} \quad EL_{ações} \quad EL_{cam} \quad EL_{com} \quad)$$

Onde:

I- $EL_{pré,j}$: exposição líquida sensível à variação da taxa de juros prefixada no vértice padrão *j* definido no anexo XX;

II- $EL_{IGPM,j}$: exposição líquida sensível à variação da taxa de juros de cupom de IGP-M no vértice padrão *j* definido no anexo XX;

III- $EL_{IPCA,j}$: exposição líquida sensível à variação da taxa de juros de cupom de IPCA no vértice padrão *j* definido no anexo XX;

IV- $EL_{TR,j}$: exposição líquida sensível à variação da taxa de juros de cupom de TR no vértice padrão *j* definido no anexo XX;

V- $EL_{câmbio,j}$: exposição líquida sensível à variação da taxa de juros de cupom cambial no vértice padrão *j* definido no anexo XX;

VI- EL_{IGPM}: exposição líquida sujeita à variação do IGP-M;

VII- EL_{IPCA}: exposição líquida sujeita à variação do IPCA;

VIII- EL_{TR}: exposição líquida sujeita à variação da TR;

IX- $\mathbf{EL}_{ações}$: exposição líquida sujeita à variação dos preços de ações;

X - $\mathbf{EL}_{cam}$: exposição líquida sujeita à variação dos preços de moedas estrangeiras e ouro; e

XI - EL_{com}: exposição líquida sujeita à variação dos preços de mercadorias.

c) $\mathbf{E}'$: transposto do vetor $\mathbf{E}$.

§2º Para efeito do cálculo descrito no **caput**, as exposições líquidas à Taxa de Juros de Longo Prazo (TJLP) e à Taxa Básica Financeira (TBF) deverão ser consideradas como exposições à TR.

§3º Para efeito do cálculo descrito no **caput**, as exposições líquidas ao IGP-DI deverão ser consideradas como exposições ao IGP-M, e as exposições ao IPC e INPC deverão ser consideradas como exposições ao IPCA.

§4º Os fluxos de caixa relativos a passivos judiciais, para os quais a supervisionada não seja capaz de definir um fator de risco adequado, deverão ser considerados como expostos ao IGP-M.