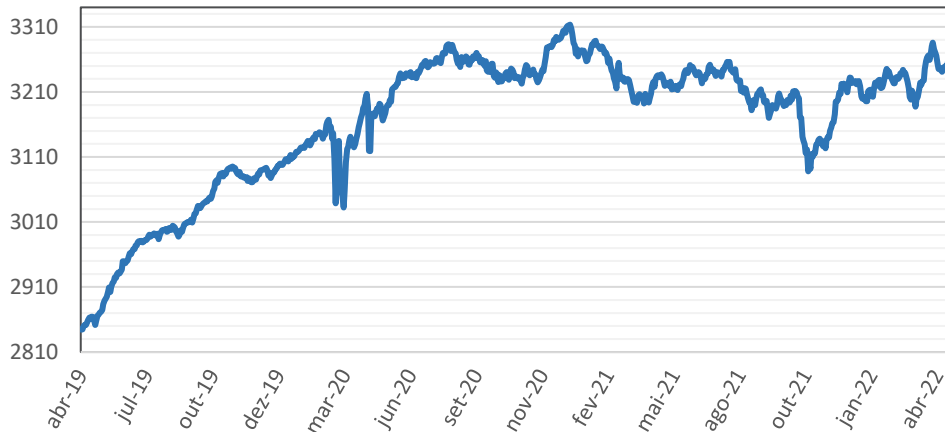


Índices de Mercado ANBIMA: IRF-M P2

O IRF-M P2 representa a evolução, a preços de mercado, da carteira de títulos públicos prefixados (LTN e NTN-F) com controle de prazo médio de repactuação da carteira de, no mínimo, dois anos.

Descrição	Valor do Índice	Número de componentes	Valor de mercado	PMR	Duration
IRF-M P2	3.259,68	15	1.231,12	747	491

Estatística de performance



Período	Retorno (%)	Risco (%)
mês	-0,20	3,40*
3 meses	1,19	3,73*
No ano	1,03	3,73*
1 ano	0,81	3,89*
2 anos	1,30*	3,58*
3 anos	4,66*	4,43*
4 anos	5,81*	4,22*
5 anos	7,19*	4,25*
6 anos	8,88*	4,09*

*Valores anualizados

CrITÉRIOS de seleção e metodologia de cálculo

Moeda	Reais (BRL)
Composição	Títulos públicos prefixados (LTN e NTN-F)
Método de ponderação	Capitalização de mercado
Prazo para vencimento	Títulos com prazo para o vencimento superior a um mês e prazo médio superior a 2 anos
Elegibilidade do título	Somente vencimentos colocados de forma competitiva - via oferta pública.
Frequência de rebalanceamento	Mensal
Período de vigência	Do primeiro dia útil após o dia 1 até o dia 1 do próximo mês
Frequência de cálculo	Diário
Fonte de preços	ANBIMA
Data do primeiro valor do índice	Março de 2005

Acesse a metodologia do índice: anbi.ma/metodologia-ima

Valor do índice: número-índice no último dia útil do mês de referência

Número de componentes: quantidade de componentes da carteira teórica no último dia útil do mês de referência

Valor de mercado: valor do índice em bilhões de reais

PMR (d.c.): prazo médio de repactuação do componente, expresso em dias corridos

Duration (d.u.): duration de Macaulay ponderada pelo valor de mercado de cada componente e expressa em dias úteis

Isenções de responsabilidade

A divulgação do índice tem caráter meramente informativo, sendo sua utilização optativa. A ANBIMA não se responsabiliza por eventuais danos ou prejuízos que venham a ser causados ao usuário, ou qualquer terceiro, pela tomada de decisão com base na utilização do índice, assumindo, neste caso, o próprio usuário que dele fizer uso, a integral e exclusiva responsabilidade.

Todos os índices, números, indicativos e cálculos estimativos não oficiais determinados pela própria ANBIMA somente devem ser utilizados como mera referência de mercado, não possuindo exatidão, precisão e/ou valor legal de informação oficial publicada por órgão governamental regulador ou entidade competente para fazê-lo. O usuário, quando fizer referência à fonte ANBIMA, deverá deixar de forma clara ao seu cliente a isenção de responsabilidade por parte da Associação.

