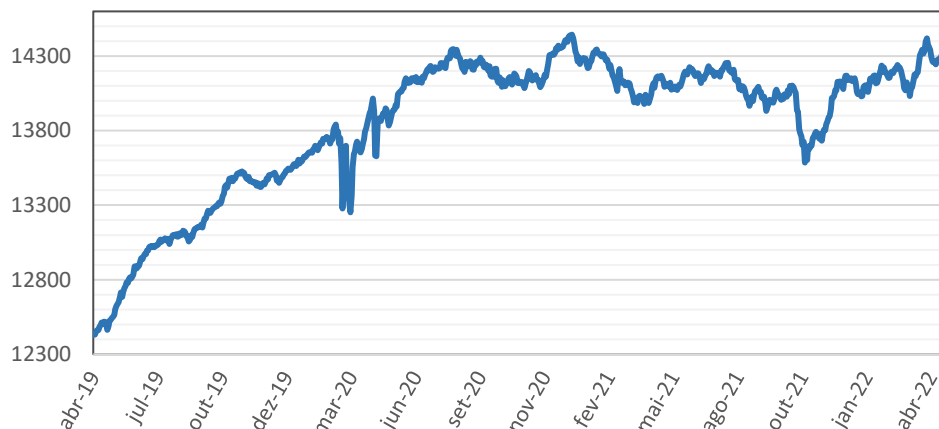


Índices de Mercado ANBIMA: IRF-M

O IRF-M representa a evolução, a preços de mercado, da carteira de títulos públicos prefixados (LTN e NTN-F).

Descrição	Valor do Índice	Número de componentes	Valor de mercado	PMR	Duration	Convexidade	Yield	Redemption Yield
IRF-M	14.325,53	16	1.358,03	684	450	6,08	12,67	12,44

Estatística de performance



Período	Retorno (%)	Risco (%)
mês	-0,12	3,06*
3 meses	1,31	3,28*
No ano	1,23	3,32*
1 ano	1,22	3,52*
2 anos	1,59*	3,30*
3 anos	4,86*	4,29*
4 anos	5,96*	4,10*
5 anos	7,31*	4,16*
6 anos	8,98*	4,01*

*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
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	Fevereiro de 2000

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

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

Yield (%): ponderada pelo valor de mercado de cada componente

Redemption yield (%): ponderada pelo valor de mercado e ajustada pela duration de cada componente

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.

