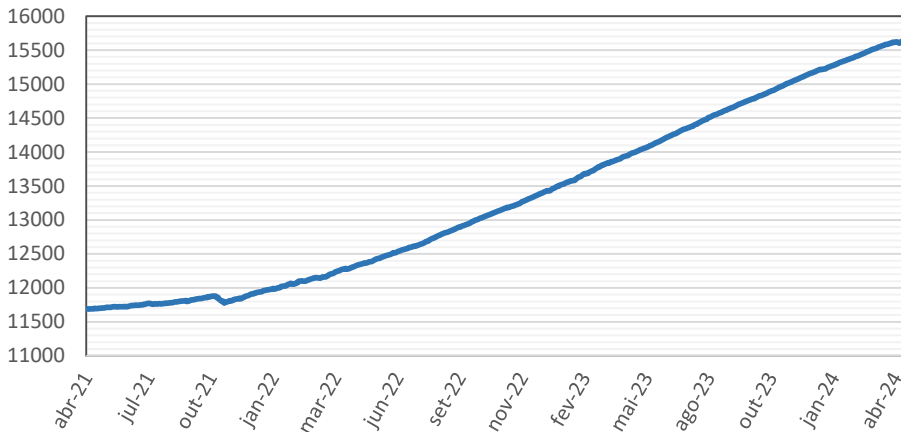


Índices de Mercado ANBIMA: IRF-M 1

O IRF-M 1 representa a evolução, a preços de mercado, da carteira de títulos públicos prefixados (LTN e NTN-F) com prazos inferiores a um ano.

Descrição	Valor do Índice	Número de componentes	Valor de mercado	PMR	Duration	Convexidade	Yield	Redemption Yield
IRF-M 1	15.669,65	5	470,70	224	155	0,87	10,27	10,29

Estadística de performance



Período	Retorno (%)	Risco (%)
mês	0,58	0,69*
3 meses	2,20	0,45*
No ano	3,05	0,41*
1 ano	11,97	0,32*
2 anos	12,69*	0,37*
3 anos	10,29*	0,55*
4 anos	8,26*	0,55*
5 anos	7,92*	0,54*
6 anos	7,72*	0,54*

*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 inferior a 1 ano
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	Dezembro 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.

