



ATA DA REUNIÃO DA COMISSÃO DE BENCHMARKS

São Paulo, 16 de outubro de 2008

PARTICIPANTES

Sílvio Luís Samuel (Itaú); Andréa Alexandre de Brito (BRZ Investimentos); Dalton Boechat (ANDIMA); Edna Camargo (CEF Fundos); Felipe Ferreira (Risk Office); Leopoldo Araújo Rodrigues (STN); Marcelo Kucuruza Mehl (ANDIMA); Marcelo Otávio Wagner (BrasilPrev); Mauricio Alessandro de Paula Ferreira (BB-DTVM); Regiane Nobrega (UAM); Sandro Baroni (ANDIMA); Sérgio Manoel Correia (LLA); Vinícius Gomes Araújo (ANDIMA); Wagner Kladt (Mercer).

PAUTA

1. Testes relativos ao filtro de volatilidade do IHFA;
2. Rebalanceamento do IHFA;
3. Estudo sobre índice replicável aos moldes do IMA;
4. Índice Corporativo – apresentação de estudos e resultados preliminares; e
5. Atividades em andamento – Manual do IMA.

DELIBERAÇÕES

- Realizar novos testes relativos a ajustes no filtro de volatilidade do IHFA;
 - Mapear os critérios para montagem de um índice replicável composto por títulos do Tesouro Nacional;
 - Pesquisar a experiência internacional de derivativos com índices de títulos públicos; e
 - Realizar novos testes do Índice Corporativo, utilizando outros parâmetros de comparação (curvas zero cupom dos títulos públicos indexados aos índices de preços, em desenvolvimento pela Área Técnica).
-