



ATA DA REUNIÃO DA COMISSÃO DE BENCHMARKS

São Paulo, 19 de novembro de 2008

PARTICIPANTES

Sílvio Luís Samuel (Itaú); Andréa Alexandre de Brito (BRZ Investimentos); Demetrius Durante (ANDIMA); Edna Camargo (CEF Fundos); Júlio César Alves Vieira (Geap); Leopoldo Araújo Rodrigues (STN); Luis Roberto Zaratín (BRAM); Marcelo Kucuruza Mehl (ANDIMA); Mauricio Alessandro de Paula Ferreira (BB-DTVM); Renê L. Burim (Safra); Sandro Baroni (ANDIMA); Sérgio Manoel Correia (LLA); Valéria Arêas Coelho (ANDIMA).

PAUTA

1. Testes relativos ao filtro de volatilidade do IHFA;
2. Estudo sobre índice replicável aos moldes do IMA;
3. Índice Corporativo – apresentação de estudos e resultados preliminares; e
4. Assuntos diversos.

DELIBERAÇÕES

- Manter a atual metodologia de cálculo do IHFA;
 - Formar um grupo de estudo com o objetivo de avaliar metodologias alternativas para criação de um índice replicável composto por títulos do Tesouro Nacional;
 - Elaborar metodologia com critérios de elegibilidade para criação do Índice de Debêntures;
 - A Área Técnica enviará a minuta do Manual de Renda Fixa para coletar, junto aos participantes, sugestões e críticas até o final de dezembro.
-