



Ata da Reunião da Comissão de Benchmarks

Rio de Janeiro, 10 de dezembro de 2009

Participantes

Sílvio Luís Samuel (Itaú); Alexandre Farias Frota (BNY Mellon); Demetrius Durante (ANBIMA); Edna Camargo (CEF Fundos); Fábio Landi (Santander Asset); Frederico Muniz (BNP Paribas Asset); Hudson Bessa (ANBIMA); Luis Augusto de Oliveira (BBDTVM); Marcelo de Castro Elmer (Previ); Marcelo Kucuruza Mehl (ANBIMA); Marcelo Nazareth (NetQuant); Marcelo Wagner (BrasilPrev); Nelson Heleno (ANBIMA); Renê Burim (Safra Asset); Sandro Baroni (ANBIMA); Sérgio Manoel Correia (LLA); Valéria Arêas Coelho (ANBIMA); Vinícius Gomes Araújo (ANBIMA).

Convidado

Ricardo Luiz - Representante da Booz & Company

Pauta

- 1 – Revisão da Metodologia do IHFA - Criação de Subíndices por Estratégia
 - 2 – Proposta para divulgação do lançamento dos IDkA e da nova Metodologia do IMA e estratégias de divulgação dos índices;
 - 3 – Pauta 2010;
 - 4 – Assuntos diversos.
-

Deliberações

- Realizar *back test*, desde o início da série histórica do IHFA para as recém-criadas categorias ANBIMA de fundos por estratégia - Macro, Multiestratégia, Long and Short Direcional e Long and Short Neutro.
 - Incluir na Metodologia do IHFA a possibilidade de uso da base de dados da ANBIMA (SI-Anbid) como contingência, para cálculo do índice na ocorrência de eventos que impossibilitem a captura das informações via CVM, a fim de garantir a tempestividade na divulgação do IHFA.
 - Alterar a Metodologia do IHFA de modo a excluir fundos que não divulgam o valor das cotas atualizadas diariamente.
 - Agendar, para o início do próximo ano apresentações na Abrapp e em outros fóruns da própria ANBIMA para dar ampla divulgação às alterações metodológicas do IMA.
-