
ATA DA REUNIÃO DO COMITÊ DE PRECIFICAÇÃO DE ATIVOS

Rio de Janeiro e São Paulo, 25 de setembro de 2008

PARTICIPANTES

Arnaldo Vollet (BB DTVM), Alexandre Ribeiro Barbosa (Banco do Brasil), Alexandre Barcellos Rodrigues (Banco UBS Pactual), Alexandre Kenichi Ono (Credit Suisse Hedging Griffo), Aline da Silva Arruda (Caixa Asset), Ana Lúcia Andrade (ANDIMA), Dalton Boechat (ANDIMA), Daniela Kubudi (ANDIMA), Edson Kojo (UAM), Fábio Landi Strutzel (Santander Asset), José Luiz Toledo de Olival (Bradesco Asset), Leonardo Medina (ANDIMA), Leonardo Zago Curi (Western Asset), Marcelo Ferreira (HSBC Asset), Marcos Watanabe (Banco Itaú), Maurício Ferreira (BB DTVM), Silvio Samuel (Banco Itaú), Sérgio Battaglia (BNY Mellon), Sandro Baroni (ANDIMA), Saša Markus (Renascença DTVM), Valdecir Sicchieri (Caixa) e Valéria Arêas Coelho (ANDIMA)

PAUTA

- Mapeamento das formas de precificação para TPF e debêntures;
- Precificação de ativos ilíquidos;
- Apresentação dos resultados do novo intervalo indicativo de TPF;
- Estrutura a termo de juros;
- Assuntos diversos.

DELIBERAÇÕES

- Será disponibilizado novamente o desvio padrão da amostra de títulos públicos federais que foi excluído da publicação Mercado Secundário em virtude da inclusão do novo intervalo indicativo;
- O acompanhamento intradia das taxas de TPF utilizando o DI futuro e a divulgação do novo intervalo indicativo para LFT deverão ocorrer até o final do ano;
- Na próxima reunião do Comitê de Precificação de Ativos, será apresentada a minuta do questionário sobre o mapeamento das formas de precificação utilizadas pelos *price makers* da ANDIMA.