



Ata da Reunião do Comitê de Precificação de Ativos

Rio de Janeiro e São Paulo, 11 de fevereiro de 2010

Participantes

Alexandre Ono (Credit Suisse Hedging Griffo), Aline da Silva Arruda (Caixa Asset), André Cadime Godói (Santander Asset), Arnaldo Vollet (XP Investimentos), Dalton Boechat (ANBIMA), Geraldo Pelluchi Jr. (Banco Votorantim), Gilberto Furquim (C.M. Capital Markets), José Luiz Toledo Olival (Bradesco Asset), Luiz Felipe Dória (Convenção CVC), Marcelo Ferreira Santos (HSBC Investimentos), Maurício Ferreira (BB DTVM), Nelson Rocha (Banco Ribeirão Preto), Ronaldo Lima de Souza (CEF), Ronnie Tavares (Banco Bradesco), Sandro Baroni (ANBIMA) e Valéria Arêas Coelho (ANBIMA).

Pauta

- 1 – Planejamento estratégico para as atividades do Comitê de Precificação de Ativos;
 - 2 – Precificação de operações compromissadas longas;
 - 3 – Precificação de CDB;
 - 4 – Precificação de Ativos Ilíquidos;
 - 5 – Assuntos diversos.
-

Deliberações

- Enviar pedido de sugestões aos membros do Comitê para ampliar a divulgação dos trabalhos de precificação de títulos públicos e debêntures;
- Enviar aos membros do Comitê pedido de curvas de modelagem de crédito para auxílio no trabalho de desenvolvimento de curvas para ativos privados pela Associação;
- Solicitar da amostra o envio das taxas de debêntures baseadas em lotes de R\$ 1 milhão;
- Utilizar, ainda como período de teste, as informações de ofertas nos mercados eletrônicos, com lote de R\$ 1 milhão, para corte das taxas de debêntures recebidas pela Associação da amostra;
- Montar o Grupo de Trabalho sobre Precificação de Operações Compromissadas longas.