

1º dia - sábado

Abertura (30 min)

- Falas iniciais de boas-vindas
- Apresentação da proposta do evento e objetivos

Painel 1 – Introdução às Finanças Quantitativas (1 hora + 15 min)

Descrição:

Apresentação e panorama sobre Finanças Quantitativas, destacando sua relevância no mercado financeiro e o uso de dados, estatística e tecnologia em relação às abordagens tradicionais.

Temas abordados:

- O que são Finanças Quantitativas e onde são aplicadas?
- **Histórico e evolução da área**
- Diferenças entre abordagem quantitativa e tradicional no investimento e na gestão de risco
- Principais áreas de atuação: trading algorítmico, precificação de ativos, análise de risco e gestão de portfólio
- Impacto da tecnologia e uso de dados no setor financeiro

Empresa responsável pelo painel: Goldman Sachs

Painel 2 – Fundo Quant Brasileiro: Desafios e Oportunidades (1 hora + 15 min)

Descrição:

Discussão sobre os fundos quantitativos no Brasil, abordando os desafios operacionais, regulatórios e estratégicos, além das oportunidades de crescimento no país.

Temas abordados:

- Como funciona um fundo quantitativo no Brasil?
- Diferenças entre fundos quants brasileiros e internacionais
- Desafios do setor: liquidez, custos operacionais, infraestrutura e regulação
- Oportunidades e tendências para o crescimento do mercado quant no Brasil

Empresa responsável pelo painel: Giant Steps

Coffee break (30 min)

Apresentação Liga (FGV Quant) (30 min + 15 min)

- Apresentação institucional da liga
- Showcase de projeto ou pesquisa aplicada em finanças quantitativas

Apresentação Liga (Poli Quant) (30 min + 15 min)

- Apresentação institucional da liga
- Showcase de projeto ou pesquisa aplicada em finanças quantitativas

Dinâmica 1 - Workshop patrocinado (1 hora)

Descrição:

Workshop interativo oferecido pela TradingView, com foco nos fundamentos da análise técnica aplicada ao mercado de criptoativos. A sessão contará com uma introdução conceitual, seguida de demonstrações práticas na plataforma TradingView, explorando suas funcionalidades mais relevantes para quants.

Tema abordado:

- Fundamentos da Análise Técnica em Cripto e Ferramentas da TradingView

Formato:

- Introdução aos princípios da análise técnica com foco em criptoativos
- Demonstração prática de indicadores, padrões gráficos e estratégias usando a plataforma
- Apresentação de recursos avançados e diferenciais da TradingView no universo cripto
- Sessão interativa para os participantes explorarem a plataforma (com acesso temporário, se possível)
- Espaço final para perguntas, troca de experiências e networking com especialistas da empresa

Empresa responsável pelo painel: TradingView

2º dia - sábado

Abertura (30 min)

- Boas-vindas ao segundo dia
- Introdução às atividades do dia

Painel 3 – Como nasce uma estratégia quantitativa? Da ideia à execução (1 hora + 15 min)

Descrição:

Exploração dos princípios de criação, validação e ajuste de estratégias quantitativas bem-sucedidas, sem foco em detalhes técnicos ou matemáticos.

Temas abordados:

- **De onde vêm as ideias para estratégias?** – Exemplos de fontes de inspiração, como anomalias de mercado, papers acadêmicos e eventos macroeconômicos.
- **Como testar uma estratégia?** – Introdução ao conceito de backtesting, principais erros comuns (viés de look-ahead, overfitting). Principais desafios na implementação: impacto de mercado, risco de execução e viés de backtesting.
- **Transformando um modelo teórico em estratégia operacional** – Diferenças entre simulação e execução real, desafios como fricções de mercado e custos de transação.
- **Exemplos práticos de estratégias quantitativas conhecidas** – Exemplo de uma estratégia trend-following e uma de mean reversion.

Empresa responsável pelo painel: Avantgarde

Painel 4 – Carreira em Finanças Quantitativas: o que o mercado procura?

(1 hora + 15 min)

Descrição:

A entrada no setor de Finanças Quantitativas pode parecer nebulosa para estudantes, especialmente no Brasil. Este painel esclarece o que realmente importa para quem quer ingressar na área, quais habilidades são mais valorizadas e como desenvolver um perfil competitivo.

Temas abordados:

- Áreas de atuação: research, trading, risco, machine learning, infraestrutura
- Habilidades essenciais para o mercado e como desenvolvê-las
- Diferenças entre o mercado brasileiro e internacional na contratação
- Dicas práticas para conseguir estágios e primeiros empregos

Empresa responsável pelo painel: XP

Coffee break (30 min)

Apresentação Liga (FEA.Dev) (30 min + 15 min)

- Apresentação institucional da liga
- Showcase de projeto ou pesquisa aplicada em finanças quantitativas

Apresentação Liga (Insper Quant) (30 min + 15 min)

- Apresentação institucional da liga
- Showcase de projeto ou pesquisa aplicada em finanças quantitativas

Painel 5 – Produzindo Estratégias: Como transformar modelos quantitativos em negócios reais (1 hora)

Descrição:

Neste painel, vamos explorar o movimento emergente dos quants empreendedores: profissionais que transformam suas estratégias em produtos, utilizando infraestruturas terceirizadas para operar como verdadeiras gestoras ou prop firms. Discutiremos como é possível tirar uma estratégia do papel e transformá-la em um veículo de investimento rentável, sem a necessidade de criar uma asset tradicional.

Temas abordados:

- O perfil do quant empreendedor
 - o Casos reais de quants que fundaram suas próprias prop firms, gestoras boutique ou fundos sistemáticos com baixo overhead.
- Infraestrutura como serviço: o que existe disponível hoje?
- Como transformar uma estratégia em um “produto investível”
- Distribuição e monetização: como ganhar dinheiro com a sua estratégia?

Empresa responsável pelo painel: InvestSmart