

# Desafio Quant AI 2025



## Diretrizes para Entrega do Relatório Final – Desafio Quant AI

### Formato e Envio

O relatório deverá ser encaminhado em formato PDF com o nome: [Chave de envio].pdf.

*Exemplo:* AABC.pdf.

As instruções para envio por e-mail serão publicadas no canal oficial de comunicação no dia 29 de outubro.

### Template do Relatório

No documento, apresentamos os elementos que deverão compor o relatório final, bem como as principais seções que deverão ser contempladas. É fundamental que os grupos observem atentamente os limites estabelecidos e as restrições descritas abaixo.

#### Formato de entrega:

O relatório deverá ser entregue exclusivamente em formato PDF.

#### Estilo e identidade visual:

O modelo, layout, cores, tipografia e demais elementos visuais do relatório são de livre escolha do grupo. No entanto, é imprescindível que o documento não contenha qualquer informação que permita a identificação do grupo.

#### Restrições de identificação:

Não é permitido incluir nomes dos participantes, logotipos, brasões, slogans ou qualquer outro elemento que remeta de forma direta à universidade de origem. Solicitamos o uso do bom senso: não haverá busca ativa por referências indiretas ou sutis, mas qualquer menção explícita será considerada uma infração às regras.

# Desafio Quant AI 2025



## Estrutura do Relatório Final

São 3 páginas obrigatórias + até 7 páginas livres + 1 página opcional, seguindo esta ordem:

1. Página Inicial – 1 página
2. Página Factsheet – 1 página
3. Desenvolvimento do Trabalho – 1 a 7 páginas
4. Página IA Generativa – 1 página
5. Bibliografia – 1 página (opcional)

A seguir, serão apresentadas as seções que deverão compor o relatório final, acompanhadas da descrição dos limites específicos de cada uma, incluindo restrições quanto ao número de palavras, gráficos e figuras permitidos por seção.

### 1. Página Inicial

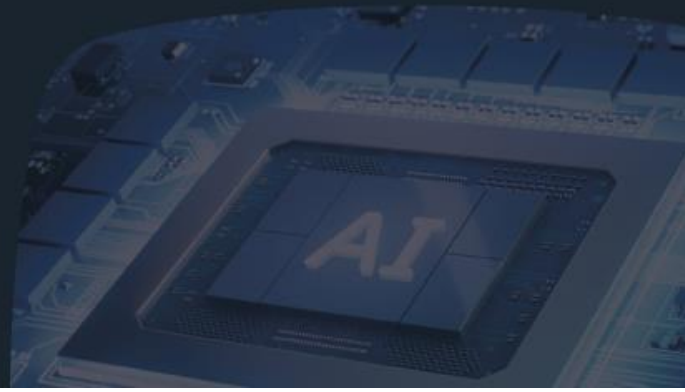
**Limite:** 1 página e até 500 palavras (incluindo cabeçalho).

Deve conter todas as informações do pré-relatório, incluindo design do robô.

Observações:

- Não adicionar informações extras além do solicitado no pré-relatório.
- Formatação livre (pode usar o template do Excel ou criar seu próprio design).

# Desafio Quant AI 2025



## 2. Página Factsheet

**Essa é uma novidade do desafio:** criar 1 página visual explicando a sua estratégia.

Não existe template oficial. Não há certo ou errado. Todos receberão as mesmas instruções e cabe ao grupo interpretar.

**Objetivo:** Traduzir a complexidade do modelo quantitativo em uma narrativa visual clara e convincente, como se fosse um pitch visual para um comitê de investimento.

Estrutura sugerida:

1. Identidade do Robô: Nome + identidade visual criativa.
2. Tese de Investimento (Porquê): Qual ineficiência ou oportunidade a estratégia explora?
3. Universo de Ativos (Onde): Classes de ativos utilizadas.
4. Fluxograma da Lógica (Como): Fontes de dados, condições para sinais de compra/venda, filtros ou regras adicionais.

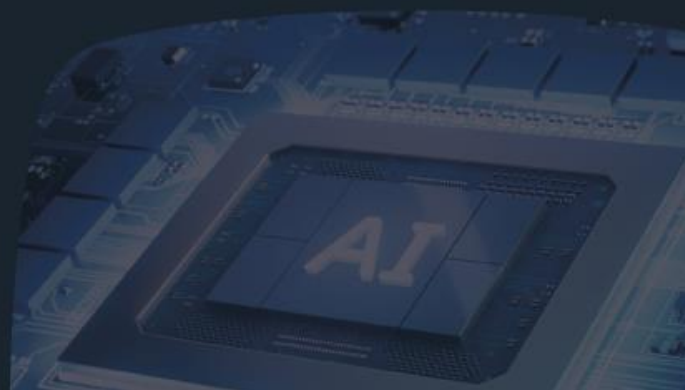
Diretrizes:

- Foco no visual (diagramas, ícones, infográficos).
- Texto mínimo (legendas curtas).

Proibido incluir:

- Resultados de backtest.
- Métricas de performance (Sharpe, Drawdown, etc.).
- Qualquer dado de retorno.

# Desafio Quant AI 2025



## 3. Desenvolvimento do Trabalho

**Limite:** até 7 páginas, 1800 palavras, 10 tabelas e 10 gráficos.

**Objetivo:** Apresentar a estratégia de forma clara e convincente para um gestor.

**Importante:** O roteiro abaixo é apenas uma sugestão. O grupo pode alterar a ordem, incluir novas análises ou excluir pontos que não façam sentido. Faz parte do desafio decidir como organizar e apresentar a ideia de investimento. Não existe formato obrigatório, mas recomendamos seguir uma comunicação prática e direta, como se estivessem apresentando para um gestor de fundo — não é um artigo acadêmico.

Sugestão de Roteiro Explicado:

**a) Ideia de Investimento:** Explique o conceito geral da sua estratégia. Imagine que você está conversando com um gestor e diz: "Tive uma ideia de investimento que teste e quero te mostrar." Ele vai perguntar: "Me explica então!" Aqui você deve dar um overview simples e direto da lógica por trás da ideia, sem entrar em detalhes técnicos ainda.

**b) Regra de Investimento:** Depois de apresentar a ideia, explique como ela foi sistematizada. Exemplo: Ideia: "Ações que vão bem em um mês tendem a ir bem no próximo." Regra: "Todo final de mês, comprar as 10 melhores ações." Ou seja, descreva como a estratégia é executada na prática, com parâmetros claros.

**c) Origem da Ideia:** Conte de onde surgiu a inspiração: uma aula, um artigo, uma percepção de mercado ou uma análise exploratória de dados.

**d) Universo e Dados:** Explique quais ativos foram considerados e quais fontes de dados usaram. Qual foi o universo investível? Como os dados foram obtidos? Houve limpeza ou ajustes?

**e) Resultados:** Como apresentar os resultados do backtest. Quais gráficos e tabelas usar? Como mostrar consistência, risco e robustez? Sugestão de pontos: consistência dos resultados, risco da estratégia, robustez do modelo.

**f) Processo de Backtest:** Explique os cuidados para evitar vieses: Look-ahead bias, Overfitting,

# Desafio Quant AI 2025



Survivorship bias. Mostre que pensaram na robustez para o futuro.

**g) Conclusão:** Finalize com recomendação clara: Está pronto para indicar ao portfólio? Precisa de mais estudos? Não chegou a resultado satisfatório? Deixe explícito o próximo passo.

# Desafio Quant AI 2025



## 4. Página IA Generativa

**Limite:** 1 página, até 400 palavras (imagens ilimitadas).

**Importante:** Não existe certo ou errado nesta seção. O objetivo é explicar como a IA generativa foi usada no projeto, de forma transparente e reflexiva. A comparação será feita entre os grupos.

O que sugerimos conter:

1. Ferramentas utilizadas: Liste as ferramentas de IA generativa que o grupo usou (ex.: ChatGPT, Copilot, MidJourney, DALL-E).
2. Etapas do projeto onde aplicaram IA: Explique em quais momentos a IA foi usada (brainstorming, programação, backtest, escrita do relatório, design).
3. Casos práticos: Relate exemplos concretos onde a IA ajudou (ex.: gerar fluxograma, sugerir tratamento de dados).
4. Limitações ou erros: Comente se houve problemas (respostas imprecisas, código com bugs) e como corrigiram.
5. Reflexão final: O que aprenderam sobre o uso de IA generativa no contexto de finanças quantitativas? A IA trouxe insights reais ou apenas acelerou tarefas?

Dicas para se destacar:

- Seja transparente: não omita erros ou limitações.
- Mostre criatividade: se usaram IA de forma inovadora, isso conta pontos.
- Pode Incluir imagens: prints de diagramas gerados por IA ou exemplos visuais.
- Evite respostas genéricas: detalhe como e por que usaram IA.



# Desafio Quant AI 2025



## 5. Bibliografia (Opcional)

Limite: 1 página. Pode incluir links externos (não serão acessados na avaliação). Não obrigatório, sem penalização se ausente.

## Critérios de Avaliação

A banca seguirá os critérios abaixo (notas anônimas, sem viés):

- 1. Apresentação do Robô (5%):** Criatividade na escolha do nome, identidade visual e narrativa. Clareza em transmitir a proposta de forma simples e memorável.
- 2. Conceito da Estratégia (20%):** Originalidade da ideia central. Grau de inovação em relação a estratégias tradicionais. Conexão com aplicabilidade no mercado real. Tese de alfa explícita e falsificável.
- 3. Modelagem (20%):** Estruturação lógica e consistente do modelo. Clareza na explicação dos fatores, premissas e hipóteses. Robustez no tratamento dos inputs e geração de sinais.
- 4. Backtest (15%):** Qualidade metodológica (horizonte, frequência, métricas). Cuidados contra vieses (look-ahead, overfitting, survivorship). Transparência nos parâmetros e justificativas.
- 5. Análise dos Resultados (15%):** Clareza na apresentação (gráficos, tabelas, métricas). Profundidade das interpretações (pontos fortes e fracos). Conexão dos resultados com o conceito da estratégia.
- 6. Conclusão e Próximos Passos (10%):** Síntese coerente das descobertas. Visão crítica sobre limitações. Sugestão de evolução e melhorias.
- 7. Uso de IA Generativa (15%):** Transparência no uso. Aplicação responsável e complementar. Reflexão crítica sobre benefícios e limitações. Originalidade no uso. Ganhos de produtividade mensurados.

# Desafio Quant AI 2025

