

Víctor Henriques

ECONOMISTA

Rua Edson, 200, Campo Belo, São Paulo - SP CEP:04618-030

☎ (51) 980393014 | ✉ victorhenriquesoliv@gmail.com | 🏠 oliveirahenriques.netlify.com | 🌐 victorhenriquesoliveira

Resumo

Possui graduação em Ciências Econômicas pela Universidade Federal de Viçosa (2016). É mestre em Economia Aplicada pela Universidade Federal do Rio Grande do Sul (2019). Trabalhou como Consultor Sênior em regulação pela Siglasul e foi Economista Pleno na Federação das Indústrias do Rio Grande do Sul (FIERGS), onde participou como assessor econômico e analista de projeções de cenários para a indústria gaúcha. Atualmente é Analista de Risco Sênior do Banco Santander e aluno do programa de Doutorado em Economia de Empresas, da Fundação Getúlio Vargas (EESP/FGV), com interesse na área de Finanças e Econometria Financeira. Tem experiência com otimização de portfólios, modelagem de volatilidade, gestão de risco de mercado e crédito, precificação de opções e outros temas relacionados à previsão e *nowcasting*. Possui conhecimentos avançados em linguagens de programação (Python, Matlab, SQL, Stata e R), editores de textos científicos (LaTeX e Markdown), e dashboards interativos para visualização de dados (Power BI e Shiny).

Experiência Profissional

Siglasul

CONSULTOR SÊNIOR

Rio de Janeiro - RJ

Fev. 2022 - Mai. 2022

CONSULTOR ASSOCIADO

Out. 2021 - Jan. 2022

- Consultoria para o mercado de infraestrutura com foco em concessões públicas do setor de energia elétrica, saneamento básico e gás natural.
- Modelagem de eficiência pela Análise Envolvente de Dados (DEA) no âmbito do benchmark regulatório da Agência Nacional de Energia Elétrica.
- Projeção de mercado de energia elétrica para distribuidoras por classe de consumo, nível de tensão e tipo de consumidor.

Fundação Getúlio Vargas - EESP/FGV

São Paulo - SP

PESQUISADOR ASSISTENTE

Out. 2020 - Out. 2021

- Coleta, processamento de dados e elaboração de relatórios sobre o preço, volume, taxa de retorno, e volatilidade de diversas criptomoedas.
- Implementação de ferramentas econométricas apropriadas para análise de séries de tempo no contexto multivariado.
- Produção de artigo científico que investiga o efeito *lead/lag* de uma cesta de criptomoedas sobre as demais classes de ativos financeiros.

Centro de Estudos em Finanças (FGVcef) - Fundação Getúlio Vargas - EAESP/FGV

São Paulo - SP

PESQUISADOR ASSISTENTE

Ago. 2020 - Ago. 2021

- Coleta, processamento de dados e elaboração de relatórios sobre a taxa de retorno, volatilidade, e performance de portfólios de renda variável.
- Análise de indicadores de performance ESG (Environmental, Social & Governance) para diversas classes de fundos de investimentos.
- Produção acadêmica de artigos científicos que investigam estratégias de investimento sustentáveis para o mercado de ações brasileiro.

Federação das Indústrias do Rio Grande do Sul - FIERGS

Porto Alegre - RS

ECONOMISTA PLENO

Ago. 2018 - Jan. 2020

- Economista do Núcleo de Análise de Conjuntura da Unidade de Estudos Econômicos (UEE).
- Atuação nas áreas de economia internacional e comércio exterior.
- Análise setorial e elaboração de publicações regulares de estatísticas de interesse da indústria gaúcha;
- Análise e projeções de cenários econômicos para a economia gaúcha, brasileira e internacional.
- Palestras de conjuntura para o Conselho de Comércio Exterior e Relações Internacionais, presidência e aos sindicatos patronais associados.

Atividades Complementares

Revista Brasileira de Finanças - RBFin

São Paulo - SP

REVISOR DE PERIÓDICO

Jan. 2021 -

Escola de Economia de São Paulo - EESP/FGV

São Paulo - SP

MONITOR

Abr. 2022 - Jun. 2022

- Monitor da disciplina de Análise de Dados para o programa de Mestrado Profissional em Economia (MPE).
- Introdução aos conceitos de estatística descritiva, distribuições de probabilidade, inferência estatística paramétrica e não-paramétrica.

Escola de Economia de São Paulo - EESP/FGV

São Paulo - SP

MONITOR

Fev. 2022 - Abr. 2022

- Monitor da disciplina de Avaliação de Empresas para o programa de Mestrado Profissional em Economia (MPE).
- Introdução ao Custo de capital, Fluxo de caixa livre da firma e para acionistas, Valor presente ajustado, Avaliação relativa, Aquisições e takeovers.

Escola de Economia de São Paulo - EESP/FGV

São Paulo - SP

MONITOR

Out. 2021 - Dez. 2021

- Monitor da disciplina de Investimentos e Mercados Financeiros para o programa de Pós-Graduação em Finanças e Economia (Masters).
- Introdução aos princípios básicos de finanças, explorando os conceitos da Moderna Teoria de Carteiras e Teoria de Apreçamento de Ativos.

Escola de Economia de São Paulo - EESP/FGV

São Paulo - SP

MONITOR

Ago. 2021 - Out. 2021

- Monitor da disciplina de Modelos de Previsão para o programa de Pós-Graduação em Finanças e Economia (Masters).
- Introdução aos modelos de previsão utilizando técnicas de análise de séries temporais com dados econômicos e financeiros.

Escola de Economia de São Paulo - EESP/FGV

São Paulo - SP

MONITOR

Abr. 2021 - Jul. 2021

- Monitor da disciplina de Investimentos e Mercados Financeiros para o programa de Pós-Graduação em Finanças e Economia (Masters).
- Introdução aos princípios básicos de finanças, explorando os conceitos da Moderna Teoria de Carteiras e Teoria de Apreçamento de Ativos.

Escola de Economia de São Paulo - EESP/FGV

São Paulo - SP

MONITOR

Abr. 2021 - Jul. 2021

- Monitor da disciplina de Análise de Dados para o programa de Mestrado Profissional em Economia (MPE).
- Introdução aos conceitos de estatística descritiva, distribuições de probabilidade, inferência estatística paramétrica e não-paramétrica.

Universidade Federal do Rio Grande do Sul - UFRGS

Porto Alegre - RS

PROFESSOR ASSISTENTE (ESTÁGIO DOCÊNCIA)

Mar. 2018 - Jul. 2018

- Professor assistente da disciplina de Econometria de Séries Temporais para o curso de graduação em Ciências Econômicas.
- Introdução a séries temporais, explorando conceitos e propriedades estatísticas como estacionariedade, raiz unitária, e cointegração.

Grupo Energisa S/A

Rio de Janeiro - RJ

ESTAGIÁRIO CORPORATIVO

Jul. 2015 - Jul. 2016

- Processamento de dados e elaboração de relatórios sobre o desempenho do consumo de energia elétrica para o mercado cativo e livre.
- Assistente no processo de modelagem econométrica e projeção de mercado de eletricidade para as diversas classes do Grupo Energisa.

Formação Acadêmica

Fundação Getúlio Vargas - EESP/FGV

São Paulo - SP

DOUTORADO EM ECONOMIA DE EMPRESAS

Jan. 2020 -

- Orientador: Marcelo Fernandes
- Tese: Conditional Autoregressive Extremile Regression

Instituto de Matemática Pura e Aplicada - IMPA

Rio de Janeiro - RJ

CURSO DE VERÃO

Jan. 2021 - Mar. 2021

- Análise Real e Economia Matemática (Carga horária: 96 horas)

Universidade Federal do Rio Grande do Sul-UFRGS

Porto Alegre - RS

MESTRE EM ECONOMIA APLICADA

Mar. 2017 - Mar. 2019

- Orientador: Eduardo de Oliveira Horta
- Dissertação: Previsão de volatilidade a tempo discreto: Uma abordagem via regressão quantílica

Universidad de Caldas

Manizales - Caldas (Colômbia)

MOBILIDADE ACADÊMICA

Jul. 2014 - Dez. 2014

- Curso: *Administración Financiera* (Carga Horária: 240 horas)

Universidade Federal de Viçosa - UFV

Viçosa - MG

BACHAREL EM CIÊNCIAS ECONÔMICAS

Mar. 2011 - Jul. 2016

- Orientador: Evandro Camargos Teixeira
- Monografia: A demanda residencial por energia elétrica no Brasil.

Prêmios e Bolsas

BOLSAS DE ESTUDO

- | | | |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|
| 2022 | Auxílio à Pesquisa , Bolsa de estudos da Fundação de Amparo à Pesquisa do Estado de São Paulo (FAPESP) | São Paulo, SP |
| 2020 | Programa de Excelência Acadêmica (PROEX) , Bolsa de estudos para Doutorado (CAPES) | São Paulo, SP |
| 2017 | Programa de Demanda Social , Bolsa de estudos para Mestrado (CAPES) | Porto Alegre, RS |

Produção bibliográfica

ARTIGOS COMPLETOS PUBLICADOS EM PERIÓDICOS

Revista Brasileira de Finanças - RBFin

São Paulo - SP

DISCRETE-TIME VOLATILITY FORECASTING: A QUANTILE REGRESSION APPROACH

Nov. 2021

- Autores: Victor Henriques de Oliveira e Eduardo de Oliveira Horta

Revista Catarinense de Economia

DEMANDA RESIDENCIAL POR ENERGIA ELÉTRICA NO BRASIL (2004-2015)

- Autores: Victor Henriques de Oliveira, Ricardo de Souza Tavares e Luís Antônio Tavares.

Florianópolis - SC

Jan. 2018

TRABALHOS COMPLETOS PUBLICADOS EM ANAIS DE CONGRESSOS

XXI Encontro Brasileiro de Finanças

DOES THE ESG INVESTMENT STRATEGY GENERATE ALPHA? EVIDENCE FROM BRAZILIAN STOCK MARKET

- Autores: Victor Henriques de Oliveira, Claudia Yoshinaga e William Eid.

Online

Jul. 2021

XXI Encontro Brasileiro de Finanças

FALSE DISCOVERIES AND LUCK IN THE BRAZILIAN EQUITY FUND MARKET

- Autores: Henrique Lamounier Costa, Alan de Genaro e Victor Henriques de Oliveira.

Online

Jul. 2021

41º Encontro Brasileiro de Econometria

DISCRETE-TIME VOLATILITY FORECASTING: A QUANTILE REGRESSION APPROACH

- Autores: Victor Henriques de Oliveira e Eduardo de Oliveira Horta

São Paulo - SP

Dez. 2019

PARTICIPAÇÃO EM EVENTOS, CONGRESSOS, EXPOSIÇÕES E FEIRAS

Minicurso - Dr. Alexandre Chiavegatto Filho (FSP/USP)

INTRODUÇÃO A MACHINE LEARNING COM FOCO EM SAÚDE (CARGA HORÁRIA: 20 HORAS)

Porto Alegre - RS

Ago. 2018

Minicurso - Dr. Marcelo Portugal (PPGE/UFRGS)

HISTÓRIA DAS IDÉIAS ECONÔMICAS (CARGA HORÁRIA: 20 HORAS)

Porto Alegre - RS

Out. 2017

Minicurso - Dr. Caio Piza (World Bank)

AValiação de Impacto Experimental: Teoria e Prática (CARGA HORÁRIA: 10 HORAS)

Porto Alegre - RS

Jun. 2017

Competências e Habilidades Técnicas

Back-end e Front-end	Shiny, Hugo
Linguagem de edição de texto	LaTeX, Markdown, Quarto
Linguagem de programação	Git, Python, Matlab, SQL, Stata, Spark, R
Idiomas	Português, Inglês e Espanhol