

# Mercado financeiro

Tiago M. Magalhães

Departamento de Estatística - ICE-UFJF

Juiz de Fora, 16 de junho de 2026



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



# Experiência

- Período: Janeiro a dezembro de 2016;
- Cargo: Analista de pesquisa quantitativa senior;
- Empresa: Itaú Asset Management, Itaú-Unibanco S.A.;
- Fruto: On the performance of VWAP execution algorithms<sup>1</sup>. *Global Trading Q4 (60)*, 43–45. 2016. (com H. Takada).



---

<sup>1</sup>[globaltrading.net/on-the-performance-of-vwap-execution-algorithms/](http://globaltrading.net/on-the-performance-of-vwap-execution-algorithms/)

# Experiência

- Período: Janeiro a dezembro de 2016;
- Cargo: Analista de pesquisa quantitativa senior;
- Empresa: Itaú Asset Management, Itaú-Unibanco S.A.;
- Fruto: On the performance of VWAP execution algorithms<sup>1</sup>. *Global Trading Q4 (60)*, 43–45. 2016. (com H. Takada).

---

<sup>1</sup>[globaltrading.net/on-the-performance-of-vwap-execution-algorithms/](http://globaltrading.net/on-the-performance-of-vwap-execution-algorithms/)

# Itaú Asset Management

- A *Itaú Asset Management* (IAM) é a área interna do Itaú especializada em gestão de recursos de clientes.



---

<sup>2</sup>Ranking Anbima, outubro 2016

# Itaú Asset Management

- A *Itaú Asset Management* (IAM) é a área interna do Itaú especializada em gestão de recursos de clientes.
- É a maior gestora privada de fundos do Brasil, com mais de R\$ 600 bilhões de recursos sob gestão<sup>2</sup>.



---

<sup>2</sup>Ranking Anbima, outubro 2016

# Itaú Asset Management

- A *Itaú Asset Management* (IAM) é a área interna do Itaú especializada em gestão de recursos de clientes.
- É a maior gestora privada de fundos do Brasil, com mais de R\$ 600 bilhões de recursos sob gestão<sup>2</sup>.
- Conta com escritórios nos principais centros financeiros do mundo: Buenos Aires, Dubai, Nova Iorque, Santiago e São Paulo.



---

<sup>2</sup>Ranking Anbima, outubro 2016

# Itaú Asset Management

- A *Itaú Asset Management* (IAM) é a área interna do Itaú especializada em gestão de recursos de clientes.
- É a maior gestora privada de fundos do Brasil, com mais de R\$ 600 bilhões de recursos sob gestão<sup>2</sup>.
- Conta com escritórios nos principais centros financeiros do mundo: Buenos Aires, Dubai, Nova Iorque, Santiago e São Paulo.



---

<sup>2</sup>Ranking Anbima, outubro 2016

# Itaú Asset Management

- Localizado na Rua Faria Lima, 3500, Itaim Bibi, São Paulo/SP, Brasil<sup>3</sup>.
- Em um prédio que custou R\$ 1,46 bilhão<sup>4</sup>.

---

<sup>3</sup>-23.586758836507702, -46.68297861534262

<sup>4</sup>[g1.globo.com/economia/noticia/2024/01/19/itau-compra-sede-na-faria-lima-por-quase-r-15-bilhao.ghtml](https://g1.globo.com/economia/noticia/2024/01/19/itau-compra-sede-na-faria-lima-por-quase-r-15-bilhao.ghtml)

# Itaú Asset Management

- Localizado na Rua Faria Lima, 3500, Itaim Bibi, São Paulo/SP, Brasil<sup>3</sup>.
- Em um prédio que custou R\$ 1,46 bilhão<sup>4</sup>.

---

<sup>3</sup>-23.586758836507702, -46.68297861534262

<sup>4</sup>[g1.globo.com/economia/noticia/2024/01/19/itau-compra-sede-na-faria-lima-por-quase-r-15-bilhao.ghtml](https://g1.globo.com/economia/noticia/2024/01/19/itau-compra-sede-na-faria-lima-por-quase-r-15-bilhao.ghtml)



Figura 1: FL 3500 (Créditos: Google images).

# Superintendência de Pesquisa Quantitativa

- Área de pesquisa do IAM responsável por desenvolver modelos.
- Atende todas as áreas da Asset como: *High alpha*, *Portfolio solutions*, *Private*, *SPE* e *Trading*.



# Superintendência de Pesquisa Quantitativa

- Área de pesquisa do IAM responsável por desenvolver modelos.
- Atende todas as áreas da Asset como: *High alpha*, *Portfolio solutions*, *Private*, *SPE* e *Trading*.

*Rest in peace.*



# Superintendência de Pesquisa Quantitativa

- Área de pesquisa do IAM responsável por desenvolver modelos.
- Atende todas as áreas da Asset como: *High alpha*, *Portfolio solutions*, *Private*, *SPE* e *Trading*.

*Rest in peace.*



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil**
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



O perfil de quem trabalha no Mercado Financeiro pode ser dividido em dois:





Figura 2: “Folha ao vento” (Créditos: Google images).



Figura 3: “Rolo compressor” (Créditos: Google images).

A divisão do dinheiro em um banco é a seguinte:

- Tesouraria;
- *Asset* (área de atacado).

A divisão do dinheiro em um banco é a seguinte:

- Tesouraria;
- *Asset* (área de atacado).

Em uma corretora, só existe o segundo item.

A divisão do dinheiro em um banco é a seguinte:

- Tesouraria;
- *Asset* (área de atacado).

Em uma corretora, só existe o segundo item.

\$\$\$ ⇒ Área de atacado

(Bônus  $\neq$  PLR)



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento**
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



# Conhecimento

De maneira simples, podemos dividir os conhecimentos necessários em:

- Estatístico: probabilidade, processos estocásticos e séries temporais;
- Computação: programação estruturada;
- Economia: inflação;
- Outros: *Marketing* (pessoal) e postura/etiqueta.



# Conhecimento

De maneira simples, podemos dividir os conhecimentos necessários em:

- Estatístico: probabilidade, processos estocásticos e séries temporais;
- Computação: programação estruturada;
- Economia: inflação;
- Outros: *Marketing* (pessoal) e postura/etiqueta.

**Observação:** Saber inglês é assumido conhecido.



# Conhecimento

De maneira simples, podemos dividir os conhecimentos necessários em:

- Estatístico: probabilidade, processos estocásticos e séries temporais;
- Computação: programação estruturada;
- Economia: inflação;
- Outros: *Marketing* (pessoal) e postura/etiqueta.

**Observação:** Saber inglês é assumido conhecido.



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo**
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



# On the performance of VWAP execution algorithms

**Objetivo:** Avaliar o desempenho dos *traders* e do algoritmo de *trading* nas operações de compra/venda.



# On the performance of VWAP execution algorithms

**Objetivo:** Avaliar o desempenho dos *traders* e do algoritmo de *trading* nas operações de compra/venda.





Figura 4: Mercado de ações (Créditos: Google images).

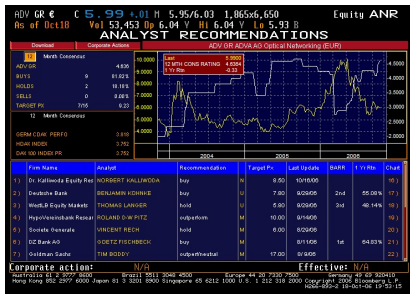


Figura 5: Painel da Bloomberg (Créditos: Google images).



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar**
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



# Como entrar

São “quatro mais um” caminhos para um aluno de graduação:

- Estágio;
- *Summer job*;
- *Trainee*;
- Desafio *Quant AI*;
- Indicação.



# Como entrar

São “quatro mais um” caminhos para um aluno de graduação:

- Estágio;
- *Summer job*;
- *Trainee*;
- Desafio *Quant AI*;
- Indicação.

**Observação:** O processo começa muito antes do surgimento da vaga.



# Como entrar

São “quatro mais um” caminhos para um aluno de graduação:

- Estágio;
- *Summer job*;
- *Trainee*;
- Desafio *Quant AI*;
- Indicação.

**Observação:** O processo começa muito antes do surgimento da vaga.

**Dica de ouro:** *Coach* (cuidado!).



# Como entrar

São “quatro mais um” caminhos para um aluno de graduação:

- Estágio;
- *Summer job*;
- *Trainee*;
- Desafio *Quant AI*;
- Indicação.

**Observação:** O processo começa muito antes do surgimento da vaga.

**Dica de ouro:** *Coach* (cuidado!). *Mentoria*.



# Como entrar

São “quatro mais um” caminhos para um aluno de graduação:

- Estágio;
- *Summer job*;
- *Trainee*;
- Desafio *Quant AI*;
- Indicação.

**Observação:** O processo começa muito antes do surgimento da vaga.

**Dica de ouro:** *Coach* (cuidado!). Mentoria.



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais**
- 7 Filmografia



# Considerações finais

O que eu trouxe da minha experiência no Itaú:

- Trabalho em equipe (lidar com pessoas de maneira geral);
- Programação estruturada;
- O que querer da vida.



# Considerações finais

O que eu trouxe da minha experiência no Itaú:

- Trabalho em equipe (lidar com pessoas de maneira geral);
- Programação estruturada;
- O que querer da vida.



# Roteiro

- 1 Experiência
- 2 Perfil
- 3 Conhecimento
- 4 Exemplo
- 5 Como entrar
- 6 Considerações finais
- 7 Filmografia



# Filmografia

- Psicopata Americano (*American Psycho*). 2000. 101 min.
- O Lobo de Wall Street (*The Wolf of Wall Street*). 2013. 180min.
- A Grande Aposta (*The Big Short*). 2015. 130min.



# Obrigado!

✉ tiago.magalhaes@ufjf.br

📄 ufjf.br/tiago\_magalhaes

🌐 Dept. de Estatística, Sala 319

