



Dois de nossos estagiários - Guilherme Cid Ferreira e Guilherme Bisaggio -, que atuam na Gerência de Fundos de Fundos e Macroalocação, estudantes da UFRJ, integram a equipe vencedora do 8º Desafio JGP, competição realizada pela gestora de recursos para estimular o conhecimento dos futuros profissionais em gestão de investimentos.

Durante quatro meses, a equipe simulou a gestão de um fundo de investimentos fictício, que saiu vencedor entre os 22 times de diversas faculdades inscritos na competição.

Pelas regras do desafio, as equipes puderam comprar e vender 18 ETFs americanos (Exchange Traded Fund), ativos negociados em bolsa de valores que buscam refletir o desempenho de um determinado índice ou segmento de mercado, como energia e tecnologia. Os quatro fundos com maior valorização de cota iriam para uma fase final, de apresentação para uma banca julgadora.

Para gerir o fundo fictício batizado de Impactus Antares, a equipe composta pelos estagiários da Petros - e por mais quatro alunos da UFRJ - dividiu-se em três grupos de trabalho, dedicados a realizar análises quantitativas, análises macroeconômicas e de controle. A estratégia da equipe foi desenvolver modelos de análise qualitativa (dados numéricos e modelos matemáticos para avaliar investimentos) e quantitativa (estatística dos preços históricos) dos ativos, usando modelos desenvolvidos por eles em linguagem de programação (Python).

Apesar do período de instabilidade nos mercados, ao final de quatro meses, o fundo Impactus Antares acumulou rentabilidade de 5,2%, o melhor desempenho entre todas as equipes do desafio. Após a apresentação da estratégia usada para a banca julgadora da JGP, a equipe foi confirmada como vencedora do desafio.

Consideramos fundamental proporcionar aprendizado e estimular os nossos estagiários a trazer novas ideias e perspectivas para a Petros, contribuindo para sua melhor preparação e, conseqüentemente, seu crescimento profissional.

**Fonte:** Petros, em 21.03.2024