

José Renato Haas Ornelas



• Phone: +55-61-9988-3074 • E-Mail: jrenato.ornelas@globo.com

Dados Pessoais

Brasileiro, Casado, 42 anos.

Experiência Profissional

Banco Central do Brasil desde 1998

- Analista - Departamento de Estudos e Pesquisas - Desde 2014.
- Assessor Pleno - Gerência-Executiva de Riscos Corporativos e Referências Operacionais - 2006 a 2013.
- Assessor Pleno - Departamento de Operação das Reservas Internacionais - Consultoria Técnica - 2000 a 2003.
- Assessor Júnior, Analista - Departamento de Operação das Reservas Internacionais - Consultoria de Planejamento, Orçamento e Informática - 1998 a 2000.

Ibmec Brasília 2011-2013

- Professor da Disciplina “Carteiras Administradas” do MBA em Finanças
- Professor da Disciplina “Avaliação de Empresas” do CBA em Finanças

Escola de Administração Fazendária, ESAF 2010-2011

- Professor da Disciplina “Mercado de Títulos e Derivativos” do Curso de Pós-Graduação em Administração Orçamentário-Financeira
- Orientador de trabalhos finais de cursos da Pós-Graduação em Administração Orçamentário-Financeira

Fundação Universa, Universidade Católica de Brasília 2008

- Professor da Disciplina “Derivativos” do MBA Executivo em Gestão Financeira

Banco Destak 1995-1997

- Atuação como Operador de Derivativos, Analista de Informações Gerenciais e Analista de Sistemas

IBM Brasil 1994-1995

- Estágio no Centro de Estudos Executivos.

Formação Acadêmica

- *University of Miami* - Pós Doutorado em Finanças 2014
- *Università Luigi Bocconi*, Doutorado em Administração 2007
- Universidade Católica de Brasília, Mestrado em Economia 2002
- Ibmec, MBA Executivo em Finanças 1999
- PUC - Rio de Janeiro, Bacharelado em Administração 1995
- Universidade Federal do Rio de Janeiro, Bacharelado em Informática 1995



Produção Científica

- ‘Combining equilibrium, resampling, and analyst’s views in portfolio optimization’, com José Luiz Barros Fernandes e Oscar Augusto Martínez Cusicanqui. *Journal of Banking and Finance*, 2012, v. 36, No 5, pp. 1354-1361.
- ‘Yes, the Choice of Performance Measure Does Matter for Ranking of US Mutual Funds’, com Antônio Francisco Silva Jr e José Luiz Fernandes. *International Journal of Finance and Economics*, 2012, v. 17, No 1, pp. 61-72.
- ‘Recovering Risk-Neutral Densities from Brazilian Interest Rate Options’, com Marcelo Takami, *Revista Brasileira de Finanças*, 2011, v. 9, p. 9-26, 2011.
- ‘A Performance Attribution Methodology for Fixed Income Portfolios’, com Antonio Francisco Silva Jr e Pablo Carvalho. Capítulo do livro ‘Portfolio and Risk Management for Central Banks and Sovereign Wealth Funds’, editado por Gabriel Petre, Joachim Coche e Ken Nyholm. Palgrave Macmillan, 2011.
- ‘Behavior of Equity Foreign Investors on Emerging Markets’, 2011, Livro publicado pela editora LAP Academic Publishing. (Baseado na minha tese de Doutorado).
- ‘Hidden Risks in Mean Variance Optimization’, com José Luiz Fernandes. Capítulo do livro ‘Interest Rate Models, Asset Allocation and Quantitative Techniques for Central Banks and Sovereign Wealth Funds’, organizado por Arjan B. Berkelaar, Joachim Coche and Ken Nyholm Palgrave Macmillan, 2010.
- ‘Accounting for Skewness in Performance Evaluation of Brazilian Mutual Funds’, com Aquiles Farias e Antonio Francisco Silva Jr., *Banking and Finance Review* v. 1, p. 119-132, 2009.
- ‘Minimising Operational Risk in Portfolio Allocation Decisions’, com José Luiz Fernandes, *Journal of Risk Management in Financial Institutions* Vol. 2, 4 pp 438-450, 2009.
- ‘Professional Portfolio Managers - A Setting for Momentum Strategies’, com José Fernandes, Benjamin Tabak e Juan Ignacio Peña, *Economía Financiera*. N° 17, maio de 2009.
- ‘Goodness-of-Fit Test Focuses on Conditional Value at Risk’, com José Fajardo e Aquiles Farias, *Revista Brasileira de Finanças*, Vol. 6, No 2, pp. 139-155, 2008.
- ‘Momentum and Reversal Puzzle in Emerging Markets’, com José Luiz Fernandes, *ICFAI Journal of Behavioral Finance*, Vol. 5, No. 3, pp. 54-71, Setembro 2008.
- ‘Integrating Market and Credit Risk in Stochastic Portfolio Optimization’, com José Luiz Fernandes e Marcelo Takami, *ICFAI Journal of Financial Risk Management* Vol. 5, No. 1, pp. 7-28, 2008.
- ‘Goodness-of-fit Tests focus on VaR Estimation’, em co-autoria com José Fajardo e Aquiles Farias, *Revista de Econometria*, v.26, p.309 - 326, 2006.
- ‘Analyzing The Use of Generalized Hyperbolic Distributions to Value at Risk Calculations’, em co-autoria com José Fajardo e Aquiles Farias, *Revista de Economia Aplicada*, v.9, p.1 - 2, 2005.
- ‘Apreçamento de Opções de IDI Usando Distribuições Hiperbólicas Generalizadas’, em co-autoria com José Fajardo, *Revista de Economia Aplicada*, v.7, p.767 - 794, 2003.
- ‘Apreçamento de Opções de IDI Usando o Modelo CIR’, em co-autoria com José Fajardo, *Estudos Econômicos*, v.33, p.1 - 2, 2003.

Mais informações em:

Currículo Lattes: <http://lattes.cnpq.br/1641812600101074>

Google Scholar Citations: <http://scholar.google.com/citations?user=BMp6QsAAAAJ>