

Aviso: [2024-07-22 09:57] este documento é uma impressão do portal Ciência-IUL e foi gerado na data indicada. O documento tem um propósito meramente informativo e representa a informação contida no portal Ciência-IUL nessa data.

António Manuel Rodrigues Guerra Barbosa

Subdiretor

Departamento de Finanças (IBS)

Professor Auxiliar

Departamento de Finanças (IBS)

Investigador Associado sem Financiamento FCT

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)

Contactos

E-mail

antonio.barbosa@iscte-iul.pt

Gabinete

D5.29

Telefone

217650524 (Ext: 220828)

Cacifo

132-A

Áreas de Investigação

Asset pricing with heterogeneous information

Information economics

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
Carnegie Mellon University	Doutoramento	Finanças	2009

ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Mestrado	Finanças	2003
Universidade Algarve	Licenciatura	Economia	2001

Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord
2024/2025	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2024/2025	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2024/2025	1º	Investimentos e Mercados Financeiros	Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas (PL); Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Sim
2024/2025	1º	Opções Financeiras	Curso de Pós Graduação em Gestão e Finanças Imobiliárias; Mestrado em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2023/2024	1º	Investimentos e Mercados Financeiros	Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas (PL); Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Sim
2023/2024	1º	Opções Financeiras	Curso de Pós Graduação em Gestão e Finanças Imobiliárias; Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2022/2023	1º	Investimentos e Mercados Financeiros	Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas (PL); Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Sim
2022/2023	1º	Opções Financeiras	Curso de Pós Graduação em Gestão e Finanças Imobiliárias; Mestrado em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim

2021/2022	1º	Investimentos e Mercados Financeiros	Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas (PL); Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Sim
2021/2022	1º	Opções Financeiras	Curso de Pós Graduação em Gestão e Finanças Imobiliárias; Mestrado em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2020/2021	1º	Investimentos e Mercados Financeiros	Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas (PL); Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Sim
2020/2021	1º	Opções Financeiras	Curso de Pós Graduação em Gestão e Finanças Imobiliárias; Mestrado em Finanças;	Sim
2019/2020	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2019/2020	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2019/2020	1º	Gestão Financeira II		Sim
2019/2020	1º	Opções Financeiras	Curso de Pós Graduação em Gestão e Finanças Imobiliárias; Mestrado em Finanças;	Sim

Orientações

• Dissertações de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Radu Cebotari	Medição e gestão do Value-at-Risk de uma carteira de ações e obrigações	Inglês	ISCTE-IUL	2023
2	Daniel Filipe Miguel Soares	Impacto de uma Pandemia e a sua gestão no risco de mercado: Análise de Values-at-Risk	Inglês	ISCTE-IUL	2022
3	Lúcia Gonçalves Nunes	Impacto do cash-flow mapping no cálculo do VaR em portefólios de obrigações	Inglês	ISCTE-IUL	2022
4	Rafael Manuel Vaz Lima	Podemos melhorar a precisão do Value-at-Risk com modelos de GARCH assimétricos e de memória longa?	Inglês	ISCTE-IUL	2021

5	Bárbara Mendes Ferreira	Os efeitos do risco sistémico em Portugal: abordagem CoVaR	Inglês	ISCTE-IUL	2020
6	Diogo Filipe Meireles Gomes	Avaliação comparativa de modelos VaR através de simulações de Monte Carlo	Inglês	ISCTE-IUL	2020
7	Teresa Silva Galhardo Dutra Jónatas	Medição do Risco Sistémico no Sistema Bancário do Sudeste Asiático: Uma Aplicação do CoVaR	Inglês	ISCTE-IUL	2020
8	Guilherme Sousa Falcão Duarte Banhudo	Otimização Adaptativa da Política de Valor de Risco: Uma Abordagem para Minimizar a Cobrança de Capital	Inglês	ISCTE-IUL	2019
9	Vladimir Krecmer	Volatilidade implícita: Podemos melhorar modelos VaR?	Inglês	ISCTE-IUL	2018
10	Tomé Domingos Gomes	Atividade de espaculação e cobertura de risco nos mercados de Futuros, relação com volatilidade e efeitos de causalidade.	Inglês	ISCTE-IUL	2018
11	Ricardo João da Silva Gouveia	Abordagem Saddle-point: avaliação de modelos de VaR na presença de perdas extremas	Inglês	ISCTE-IUL	2018
12	Mário Rui dos Santos Seixas	Optimal Value-at-Risk Policy: A model for minimizing the daily capital charge	Inglês	ISCTE-IUL	2016
13	Telma Catarina Martins Gonçalves	A Liquidez do Mercado Acionista Antecipa o Ciclo Económico na Europa?	Português	ISCTE-IUL	2015
14	Li Zongyuan	Does Contagion Really Matter? Real role of Greece in the sovereign bond crisis.	Inglês	ISCTE-IUL	2015
15	Susana de Jesus Morais Queiroga Ferreira Amaral	Saúde, espiritualidade e sentido: produção de cuidados em contexto hospitalar	Português	ISCTE-IUL	2013
16	Ricardo Noutel de Matos Correia	Can Reversal be Explained by Post-Earnings Announcement Drift or Momentum?	Inglês	ISCTE-IUL	2012

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	André Rodrigues Seatra Camelo	Stochastic Evaluation of Deepwater Oil Prospects in Portugal using Monte Carlo Simulation	Inglês	ISCTE-IUL	2013
2	Raquel Costa Carvalho Ruivo	Backtesting VaR Models - An application to Caixa Geral de Depósitos	Inglês	ISCTE-IUL	2012

Publicações

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Publicação em atas de evento científico

1	Barbosa, A. (2012). Manipulation and Information Acquisition. In Laurence Bloise and Vijay Gondhalekar (Ed.), 2012 Midwest Finance Association Annual Meeting. (pp. 1-51). New Orleans: Midwest Finance Association.
2	Barbosa, A. (2012). Manipulation and Information Acquisition. In Carlos Pinho, Mara Madaleno e Elisabete Vieira (Ed.), 2012 Portuguese Finance Network. (pp. 1-51). Aveiro
3	Barbosa, A. (2012). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. In Carlos Pinho, Mara Madaleno e Elisabete Vieira (Ed.), 2012 Portuguese Finance Network. (pp. 1-54). Aveiro

- Comunicação em evento científico

1	Barbosa, A. (2012). Manipulation and Information Acquisition. 2012 Portuguese Finance Network.
2	Barbosa, A. (2012). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2012 Portuguese Finance Network.
3	Barbosa, A. (2012). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2012 European Financial Management Association Conference.
4	Barbosa, A. (2012). Manipulation and Information Acquisition. ? 2012 Financial Management Association European Conference.
5	Barbosa, A. (2012). Manipulation and Information Acquisition. 2012 Midwest Finance Association Conference.
6	Barbosa, A. (2012). Manipulation and Information Acquisition. 2012 Eastern Finance Association Conference.
7	Barbosa, A. (2011). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2011 Eastern Finance Association Annual Meetings.
8	Barbosa, A. (2011). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2011 Midwest Finance Association Annual Meeting.
9	Barbosa, A. (2011). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2011 Financial Management Association European Conference .
10	Barbosa, A. (2011). Manipulation and Information Acquisition. European Financial Management Association 2011 Annual Meetings.

• Outras Publicações

- Working paper

1	Barbosa, A. & Seixas, M. (2019). Optimal Value-at-Risk Disclosure. MPRA working Paper No. 97526.
---	--

2	Barbosa, A. (2019). Optimal Learning, Overvaluation and Overinvestment. MPRA working Paper No. 97411.
3	Barbosa, A. (2019). The Role of Information in the Discrepancy Between Average Prices and Expectations. MPRA working Paper No. 97416.
4	Barbosa, A. & Correia, R. (2019). Can Post-Earnings Announcement Drift and Momentum Explain Reversal?. MPRA working Paper No. 97458.
5	Barbosa, A. (2011). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. Social Science Research Network Working Paper Series. 1-55

Cargos de Gestão Académica

Sub-diretor (2022 - 2026)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Sub-diretor (2022 - 2026)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Membro (Docente) (2022 - 2026)
Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2018 - 2022)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Presidente (2018 - 2022)
Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2018 - 2022)
Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2017 - 2019)
Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Membro (Docente) (2015 - 2017)
Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Membro (Docente) (2014 - 2018)
Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2014 - 2018)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Presidente (2014 - 2018)
Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2013 - 2015)
Unidade/Área: [5563] Finanças

Director (2012 - 2013)
Unidade/Área: [5563] Finanças