

Aviso: [2025-03-31 06:26] este documento é uma impressão do portal Ciência_Iscte e foi gerado na data indicada. O documento tem um propósito meramente informativo e representa a informação contida no portal Ciência_Iscte nessa data.

António Manuel Rodrigues Guerra Barbosa

Subdiretor

Departamento de Finanças (IBS)

Professor Auxiliar

Departamento de Finanças (IBS)

Membro Afiliado

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 Gestão; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Opções Financeiras | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Gestão de Risco | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2023/2024 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas; | Sim |
| 2023/2024 | 1º | Opções Financeiras | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Gestão de Risco | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2022/2023 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas; | Sim |
| 2022/2023 | 1º | Opções Financeiras | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Gestão de Risco | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2021/2022 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | | Sim |
| 2021/2022 | 1º | Opções Financeiras | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Gestão de Risco | | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Sim |

| | | | | |
|-----------|----|--------------------------------------|-------------------------|-----|
| 2020/2021 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | | Sim |
| 2020/2021 | 1º | Opções Financeiras | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Gestão de Risco | | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2019/2020 | 1º | Gestão Financeira II | | Sim |
| 2019/2020 | 1º | Opções Financeiras | Mestrado em Finanças; | Sim |

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|---|---|---|-----------|-------------|------------------|
| 1 | Susana de Jesus Morais Queiroga Ferreira Amaral | Saúde, espiritualidade e sentido: produção de cuidados em contexto hospitalar | Português | Iscte | 2013 |

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Estado | Instituição |
|---|------------------------------|---|--------|----------|-------------|
| 1 | Guilherme Santos Costa | Valor em risco: Uma ferramenta estratégica para a otimização de carteiras de investimentos e a gestão de riscos | -- | Em curso | Iscte |
| 2 | Iara Nuno Silva | Medir e gerir o valor em risco de um portfólio | -- | Em curso | Iscte |
| 3 | Obiora Celestine Chikodili | Medir e gerir o Value-at-Risk de um portfólio de ações e títulos. | -- | Em curso | Iscte |
| 4 | Ricardo Gil Dionísio Almeida | Assessing the impact of different Value-at-Risk Significance Levels for a static portfolio | -- | Em curso | Iscte |
| 5 | Daniela Marly Gonçalves | Portfolio Risk Management through Value at Risk: An empirical study of Stocks and Bonds | -- | Em curso | Iscte |
| 6 | Mariana da Cunha Barreira | How does equity hedging impact portfolio risk and RORAC? An analysis of the best performing VaR model | -- | Em curso | Iscte |

| | | | | | |
|----|---------------------------------------|--|----|----------|-------|
| 7 | Margarida Silva Fialho | Portfolio Risk Management Through Value-at-Risk (VaR) Measurement | -- | Em curso | Iscte |
| 8 | Filipa Daniela Ferragatão Branco | Avaliação e gestão do Value-at-Risk num portfólio diversificado | -- | Em curso | Iscte |
| 9 | Pedro Afonso Lage Teixeira | Analysis and management of a portfolio Value-at-Risk | -- | Em curso | Iscte |
| 10 | João Rodrigues do Rosário | Análise e gestão do Value-at-Risk de um portfólio | -- | Em curso | Iscte |
| 11 | João Pedro Gomes Bispo | Medição e gestão do Value-at-Risk num portfólio de ações e obrigações: uma análise comparativa de modelos de VaR | -- | Em curso | Iscte |
| 12 | Ricardo Filipe Marques Gomes da Silva | Portfolio Risk Dynamics: Managing Value-at-Risk Across Stocks and Bonds | -- | Em curso | Iscte |
| 13 | Louise Leal Cardoso | Backtesting and Validation of VaR Models for a Personal Stock Portfolio | -- | Em curso | Iscte |
| 14 | Joana Duarte da Costa Teixeira | Medir e gerir o Value-at-Risk de uma carteira de obrigações e ações | -- | Em curso | Iscte |

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|---|--|--|--------|-------------|------------------|
| 1 | Beatriz de Jesus Mendes Martins | Análise e gestão do risco e desempenho de um portfólio usando Value-at-Risk | Inglês | Iscte | 2024 |
| 2 | Henrique Manuel Gonçalves Barbeito Costa | Como melhorar a precisão do Value-at-risk com o risco de liquidez | Inglês | Iscte | 2024 |
| 3 | Radu Cebotari | Medição e gestão do Value-at-Risk de uma carteira de ações e obrigações | Inglês | Iscte | 2023 |
| 4 | Daniel Filipe Miguel Soares | Impacto de uma Pandemia e a sua gestão no risco de mercado: Análise de Values-at-Risk | Inglês | Iscte | 2022 |
| 5 | Lúcia Gonçalves Nunes | Impacto do cash-flow mapping no cálculo do VaR em portefólios de obrigações | Inglês | Iscte | 2022 |
| 6 | Rafael Manuel Vaz Lima | Podemos melhorar a precisão do Value-at-Risk com modelos de GARCH assimétricos e de memória longa? | Inglês | Iscte | 2021 |
| 7 | Diogo Filipe Meireles Gomes | Avaliação comparativa de modelos VaR através de simulações de Monte Carlo | Inglês | Iscte | 2020 |

| | | | | | |
|----|---------------------------------------|---|-----------|-------|------|
| 8 | Bárbara Mendes Ferreira | Os efeitos do risco sistémico em Portugal: abordagem CoVaR | Inglês | Iscte | 2020 |
| 9 | Teresa Silva Galhardo Dutra Jónatas | Medição do Risco Sistémico no Sistema Bancário do Sudeste Asiático: Uma Aplicação do CoVaR | Inglês | Iscte | 2020 |
| 10 | Guilherme Sousa Falcão Duarte Banhudo | Otimização Adaptativa da Política de Valor de Risco: Uma Abordagem para Minimizar a Cobrança de Capital | Inglês | Iscte | 2019 |
| 11 | Vladimir Krecmer | Volatilidade implícita: Podemos melhorar modelos VaR? | Inglês | Iscte | 2018 |
| 12 | Tomé Domingos Gomes | Atividade de espaculação e cobertura de risco nos mercados de Futuros, relação com volatilidade e efeitos de causalidade. | Inglês | Iscte | 2018 |
| 13 | Ricardo João da Silva Gouveia | Abordagem Saddle-point: avaliação de modelos de VaR na presença de perdas extremas | Inglês | Iscte | 2018 |
| 14 | Mário Rui dos Santos Seixas | Optimal Value-at-Risk Policy: A model for minimizing the daily capital charge | Inglês | Iscte | 2016 |
| 15 | Telma Catarina Martins Gonçalves | A Liquidez do Mercado Acionista Antecipa o Ciclo Económico na Europa? | Português | Iscte | 2015 |
| 16 | Li Zongyuan | Does Contagion Really Matter? Real role of Greece in the sovereign bond crisis. | Inglês | Iscte | 2015 |
| 17 | Ricardo Noutel de Matos Correia | Can Reversal be Explained by Post-Earnings Announcement Drift or Momentum? | Inglês | Iscte | 2012 |

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|---|-------------------------------|---|--------|-------------|------------------|
| 1 | Joana da Silva Espinheira | Value-at-Risk: medir e gerir o VaR de uma carteira composta por ações e obrigações | Inglês | Iscte | 2024 |
| 2 | André Rodrigues Seatra Camelo | Stochastic Evaluation of Deepwater Oil Prospects in Portugal using Monte Carlo Simulation | Inglês | Iscte | 2013 |
| 3 | Raquel Costa Carvalho Ruivo | Backtesting VaR Models - An application to Caixa Geral de Depósitos | Inglês | Iscte | 2012 |

• 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 Midwest Finance Association Annual Meeting. |
| 8 | Barbosa, A. (2011). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2011 Financial Management Association European Conference . |
| 9 | Barbosa, A. (2011). Manipulation and Information Acquisition. European Financial Management Association 2011 Annual Meetings. |
| 10 | Barbosa, A. (2011). Differential Interpretation of Information and the Post-Announcement Drift: A Story of Consensus Learning. 2011 Eastern Finance Association 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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Director (2013 - 2015)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças

Director (2012 - 2013)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças