Ciência_Iscte

Perfil Público

Aviso: [2025-12-05 06:16] 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.
2025/2026	2º	Gestão de Risco	Mestrado em Finanças;	Sim
2025/2026	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Sim
2025/2026	1º	Investimentos e Mercados Financeiros	Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Sim
2025/2026	1º	Opções Financeiras	Mestrado em Finanças;	Sim
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;	Não
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;	Não

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;	Não
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;	Não
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	Rodrigo Filipe Garcia Brás	How does the confidence level influence the performance of VaR models in large,diversified portfolios?	--	Em curso	Iscte
2	Amanpreet Singh	Implementação de uma estratégia de Trading usando VaR para a Gestão de Portfolios	--	Em curso	Iscte

3	Guilherme Martinho Luzio	Avaliar se a utilização de estratégias de hedging, aplicadas para manter as contribuições de risco marginais de diferentes fatores dentro de limites predefinidos, permite um portfolio mais equilibrado e eficiente.	--	Em curso	Iscte
4	Manuel Falcão Hermenegildo Droguete Ferreira	Esta tese desenvolve uma estratégia de hedging dinâmico que transforma o VaR numa ferramenta ativa. O objetivo é controlar o risco diariamente numa carteira multi-ativos, analisando os trade-offs entre retorno, RORAC e exceedances.	--	Em curso	Iscte
5	Rodrigo Filipe Raposo Mendes	Backtesting VaR Models in Cross-Asset Portfolios: A Comparative Analysis During Periods of Stress	--	Em curso	Iscte
6	Guilherme Pereira Ramos	Uma avaliação empírica da modelagem adaptativa versus estática de valor em risco	--	Em curso	Iscte
7	Diogo Miguel Antunes José	Value-at-Risk na Prática: Gestão do Risco e Estratégias de Cobertura com Meta de VaR em Portefólios de Ações e Obrigações	--	Em curso	Iscte
8	Henrique Jorge de Novais Coelho	Um Estudo Comparativo de Modelos de VaR num Portefólio Estático: Análise de Excedências e RORAC	--	Em curso	Iscte
9	Diogo Alexandre Jerónimo Gordicho	Esta tese centra-se na estimação e gestão do risco de mercado através do Value-at-Risk (VaR), aplicado a um portefólio diversificado de ações internacionais e obrigações soberanas.	--	Em curso	Iscte
10	Tiago Loução Pinto Rocharte	Valor em risco em diferentes níveis de significância: evidências de backtesting de uma carteira estática com diversos ativos	--	Em curso	Iscte
11	Tomás Santamaria Medeiros Ribeiro de Oliveira	Emerging Markets in Portfolio Risk Management	--	Em curso	Iscte
12	José Paulo Gil Pinto	Este estudo aplica diferentes modelos de VaR (Normal, SGSt, Histórico, QR) a duas carteiras - A&D (Aeroespacial e Defesa) e PROXY (diversificada) - comparando a resiliência através de backtesting sob critérios iguais.	--	Em curso	Iscte

13	Daniel Filipe Mano Augusto	O Impacto das Escolhas de Mapping de Ações sobre o VaR do Portfólio e a Eficiência de Hedging: Uma Abordagem Comparativa de Backtesting	--	Em curso	Iscte

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Iara Nuno Silva	Medir e gerir o valor em risco de um portfólio de ações e obrigações	Inglês	Iscte	2025
2	Filipa Daniela Ferragatão Branco	Avaliação e gestão do Value-at-Risk num portfólio diversificado	Inglês	Iscte	2025
3	João Rodrigues do Rosário	Análise e gestão do Value-at-Risk de um portfólio	Inglês	Iscte	2025
4	João Pedro Gomes Bispo	Medição e gestão do Value-at-Risk num portfólio de ações e obrigações: uma análise comparativa de modelos de VaR	Inglês	Iscte	2025
5	Ricardo Filipe Marques Gomes da Silva	Portfolio Risk Dynamics: Managing Value-at-Risk Across Stocks and Bonds	Inglês	Iscte	2025
6	Pedro Afonso Lage Teixeira	Analysis and management of a portfolio risk and performance using Value-at-Risk	Inglês	Iscte	2025
7	Obiora Celestine Chikodili	Medir e gerir o Value-at-Risk de um portfólio de ações e títulos.	Inglês	Iscte	2025
8	Mariana da Cunha Barreira	Dynamic hedging and risk management: a Value-at-Risk analysis in a diversified portfolio	Inglês	Iscte	2025
9	Daniela Marly Gonçalves	Gestão de Risco de Portfólio através do Value at Risk: Um Estudo Empírico sobre Ações e Obrigações	Inglês	Iscte	2025
10	Margarida Silva Fialho	Gestão de Risco de Portfólio Através da Medição do Value-at-Risk (VaR)	Inglês	Iscte	2025
11	Beatriz de Jesus Mendes Martins	Análise e gestão do risco e desempenho de um portfólio usando Value-at-Risk	Inglês	Iscte	2024
12	Henrique Manuel Gonçalves Barbeito Costa	Como melhorar a precisão do Value-at-risk com o risco de liquidez	Inglês	Iscte	2024
13	Radu Cebotari	Medição e gestão do Value-at-Risk de uma carteira de ações e obrigações	Inglês	Iscte	2023

14	Daniel Filipe Miguel Soares	Impacto de uma Pandemia e a sua gestão no risco de mercado: Análise de Values-at-Risk	Inglês	Iscte	2022
15	Lúcia Gonçalves Nunes	Impacto do cash-flow mapping no cálculo do VaR em portefólios de obrigações	Inglês	Iscte	2022
16	Rafael Manuel Vaz Lima	Podemos melhorar a precisão do Value-at-Risk com modelos de GARCH assimétricos e de memória longa?	Inglês	Iscte	2021
17	Diogo Filipe Meireles Gomes	Avaliação comparativa de modelos VaR através de simulações de Monte Carlo	Inglês	Iscte	2020
18	Bárbara Mendes Ferreira	Os efeitos do risco sistémico em Portugal: abordagem CoVaR	Inglês	Iscte	2020
19	Teresa Silva Galhardo Dutra Jónatas	Medição do Risco Sistémico no Sistema Bancário do Sudeste Asiático: Uma Aplicação do CoVaR	Inglês	Iscte	2020
20	Guilherme Sousa Falcão Duarte Banhudo	Otimização Adaptativa da Política de Valor de Risco: Uma Abordagem para Minimizar a Cobrança de Capital	Inglês	Iscte	2019
21	Vladimir Krecmer	Volatilidade implícita: Podemos melhorar modelos VaR?	Inglês	Iscte	2018
22	Tomé Domingos Gomes	Atividade de espaculação e cobertura de risco nos mercados de Futuros, relação com volatilidade e efeitos de causalidade.	Inglês	Iscte	2018
23	Ricardo João da Silva Gouveia	Abordagem Saddle-point: avaliação de modelos de VaR na presença de perdas extremas	Inglês	Iscte	2018
24	Mário Rui dos Santos Seixas	Optimal Value-at-Risk Policy: A model for minimizing the daily capital charge	Inglês	Iscte	2016
25	Telma Catarina Martins Gonçalves	A Liquidez do Mercado Acionista Antecipa o Ciclo Económico na Europa?	Português	Iscte	2015
26	Li Zongyuan	Does Contagion Really Matter? Real role of Greece in the sovereign bond crisis.	Inglês	Iscte	2015
27	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

Publicações

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Publicação em atas de evento científico

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

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

• 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

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

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

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