

Aviso: [2019-06-17 20:29] 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.

Helena Veiga

Investigadora Integrada

UNIDE-IUL - Unidade de Investigação em Desenvolvimento Empresarial (IBS)
[Finance Group]

Contactos

E-mail

Maria.Helena.Veiga@iscte-iul.pt

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Em curso

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Co-Orientador	Yaguo Deng	New problems in modelling the efficiency	Inglês	Em curso	Universidad Carlos III de Madrid

- Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Co-Orientador	João Henrique Gonçalves Mazzeu	Forecasting under model uncertainty	Inglês	Universidad Carlos III de Madrid	2016
2	Co-Orientador	Xiuping Mao	Asymmetric Stochastic Volatility Models	Inglês	Universidad Carlos III de Madrid	2015
3	Co-Orientador	Jorge Galán	Bayesian Analysis of Heterogeneity in Stochastic Frontier Models	Inglês	Universidad Carlos III de Madrid	2014

Total de Citações

Web of Science®	191
Scopus	223

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Mazzeu, J. H. G., Ruiz, E. R. & Veiga, H. (2018). Uncertainty and density forecasts of arma models: comparison of asymptotic, bayesian, and bootstrap procedures. <i>Journal of Economic Surveys</i> . 32 (2), 388-419
2	Mao, X., Ruiz, E. & Veiga, H. (2017). Threshold stochastic volatility: properties and forecasting. <i>International Journal of Forecasting</i> . 33 (4), 1105-1123
3	Ramos, S. B., Taamouti, A., Veiga, H. & Wang, C.-W. (2017). Do investors price industry risk? Evidence from the cross-section of the oil industry. <i>Journal of Energy Markets</i> . 10 (1), 79-108 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 2
4	Bahamonde, N. & Veiga, H. (2016). A robust closed-form estimator for the GARCH(1,1) model. <i>Journal of Statistical Computation and Simulation</i> . 86 (8), 1605-1619 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 3
5	Galán, J. E., Veiga, H. & Wiper, M. P. (2015). Dynamic effects in inefficiency: evidence from the Colombian banking sector. <i>European Journal of Operational Research</i> . 240 (2), 562-571 - N.º de citações Web of Science®: 12 - N.º de citações Scopus: 15
6	Martín-Barragan, B., Ramos, S. & Veiga, H. (2015). Correlations between oil and stock markets: a wavelet-based approach. <i>Economic Modelling</i> . 50, 212-227 - N.º de citações Web of Science®: 25 - N.º de citações Scopus: 27
7	Galán, J. E., Veiga, H. & Wiper, M. P. (2014). Bayesian estimation of inefficiency heterogeneity in stochastic frontier models. <i>Journal of Productivity Analysis</i> . 42 (1), 85-101 - N.º de citações Web of Science®: 8 - N.º de citações Scopus: 8
8	Grané, A. & Veiga, H. (2014). Outliers, GARCH-type models and risk measures: a comparison of several approaches. <i>Journal of Empirical Finance</i> . 26, 26-40 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 4

9	Ramos, S. B. & Veiga, H. (2013). Oil price asymmetric effects: answering the puzzle in international stock markets. <i>Energy Economics</i> . 38 (July), 136-145 - N.º de citações Web of Science®: 18 - N.º de citações Scopus: 24
10	Grané, A. & Veiga, H. (2012). Asymmetry, realised volatility and stock return risk estimates. <i>Portuguese Economic Journal</i> . 11 (2), 147-164 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1
11	Ramos, S. & Veiga, H. (2011). Risk factors in oil and gas industry returns: international evidence. <i>Energy Economics</i> . 33 (3), 525-542 - N.º de citações Web of Science®: 56 - N.º de citações Scopus: 62
12	Grané, A. & Veiga, H. (2010). Wavelet-based detection of outliers in financial time series. <i>Computational Statistics and Data Analysis</i> . 54 (11), 2580-2593 - N.º de citações Web of Science®: 28 - N.º de citações Scopus: 36
13	Veiga, H. & Vorsatz, M. (2010). Information aggregation in experimental asset markets in the presence of a manipulator. <i>Experimental Economics</i> . 13 (4), 379-398 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 8
14	Veiga, H. & Vorsatz, M. (2009). Price manipulation in an experimental asset market. <i>European Economic Review</i> . 53 (3), 327-342 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 5
15	Perez, A., Ruiz, E. & Veiga, H. (2009). A note on the properties of power-transformed returns in long-memory stochastic volatility models with leverage effect. <i>Computational Statistics and Data Analysis</i> . 53 (10), 3593-3600 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 4
16	Ruiz, E. & Veiga, H. (2008). Modelling long-memory volatilities with leverage effect: A-LMSV versus FIEGARCH. <i>Computational Statistics and Data Analysis</i> . 52 (6), 2846-2862 - N.º de citações Web of Science®: 20 - N.º de citações Scopus: 20
17	Grané, A. & Veiga, H. (2008). Accurate minimum capital risk requirements: a comparison of several approaches. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 32 (11), 2482-2492 - N.º de citações Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 4
18	Veiga, H. (2007). Are feedback factors important in modeling financial data?. <i>International Review of Finance</i> . 7 (3-4), 105-118

• Livros e Capítulos de Livros

- Capítulo de livro

1	Ramos, S. B., Veiga, H. & Wang, C.-W. (2014). Risk factors in the oil industry: un upstream and downstream analysis. In Sofia B.Ramos and Helena Veiga (Ed.), <i>The Interrelationship Between Financial and Energy</i>
---	---

Markets. (pp. 3-32). Berlim: Springer.

Associações Profissionais

Instituto Flores de Lemus (Desde 2004)

Organização/Coordenação de Eventos

Tipo de Organização/Coordenação	Título do Evento	Entidade Organizadora	Ano
Membro de comissão científica de evento científico	Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance (MAF 2018)	Universidad Carlos III de Madrid	2018
Membro de comissão científica de evento científico	Congresso Computational Financial Econometrics	Universidad de Sevilla	2016