INSTITUTO UNIVERSITÁRIO DE LISBOA

Ciência_Iscte

Perfil Público

Aviso: [2026-11-17 15:09] 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.

Helena Veiga

Investigadora Associada
BRU-Iscte - Business Research Unit

Contactos

E-mail	Maria.Helena.Veiga@iscte-iul.pt

Áreas de Investigação

Econometría Financeira; Econometría; Finanças empiricas

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
Universidad Autonoma de Barcelona	Doutoramento	Economia	2004

Orientações

- **Teses de Doutoramento**

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Yaguo Deng	New problems in modelling the efficiency	Inglês	Em curso	Universidad Carlos III de Madrid

- Terminadas

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

Total de Citações

Web of Science®	700
Scopus	666

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Ramos, S., Taamouti, A. & Veiga, H. (2025). Investigating the impact of consumption distribution on CRRA estimation: Quantile-CCAPM-based approach. Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics, 29(1), 39?52. https://doi.org/10.1515/snde-2023-0005
2	Peeters, R., Veiga, H. & Vorsatz, M. (2025). An experimental analysis of contagion in financial markets. Journal of Economic Dynamics and Control, 171. https://doi.org/10.1016/j.jedc.2024.105033 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 4
3	Bermudez, P. de Z., Marín, J. M., Rue, H. & Veiga, H. (2024). Integrated nested Laplace approximations for threshold stochastic volatility models. Econometrics and Statistics, 30, 15?35. https://doi.org/10.1016/j.ecosta.2021.08.006 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 17
4	Casas, I. & Veiga, H. (2021). Exploring option pricing and hedging via volatility asymmetry. Computational Economics, 57, 1015?1039. https://doi.org/10.1007/s10614-020-10005-5 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 6

5	Ramos, S., Latoero, P. & Veiga, H. (2020). Limited attention, salience of information and stock market activity. Economic Modelling, 87, 92?108. https://doi.org/10.1016/j.econmod.2019.07.010 - N.º de citações Web of Science®: 38 - N.º de citações Scopus: 27 - N.º de citações Google Scholar: 120
6	De Zea Bermudez, P., Marín, J. M. & Veiga, H. (2020). Data cloning estimation for asymmetric stochastic volatility models. Econometric Reviews, 39(10), 1057?1074. https://doi.org/10.1080/07474938.2020.1770997 - N.º de citações Web of Science®: 7 - N.º de citações Scopus: 7 - N.º de citações Google Scholar: 12
7	Mazzeu, J. H. G., González-Ribera, G., Ruiz, E. & Veiga, H. (2020). A bootstrap approach for generalized autocontour testing implications for VIX forecast densities. Econometric Reviews, 39(10), 971?990. https://doi.org/10.1080/07474938.2020.1761150 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 3
8	Mao, X., Czellar, V., Ruiz, E. & Veiga, H. (2020). Asymmetric stochastic volatility models: properties and particle filter-based simulated maximum likelihood estimation. Econometrics and Statistics, 13, 84?105. https://doi.org/10.1016/j.ecosta.2019.08.002 - N.º de citações Web of Science®: 13 - N.º de citações Scopus: 14 - N.º de citações Google Scholar: 33
9	Deng, Y. G., Veiga, H. & Wiper, M. P. (2019). Efficiency evaluation of hotel chains: a Spanish case study. SERIEs-Journal of the Spanish Economic Association, 10(2), 115?139. https://doi.org/10.1007/s13209-019-0188-6 - N.º de citações Web of Science®: 27 - N.º de citações Scopus: 27 - N.º de citações Google Scholar: 38
10	Mazzeu, J. H. G., Veiga, H. & Mariti, M. B. (2019). Modeling and forecasting the oil volatility index. Journal of Forecasting, 38(8), 773?787. https://doi.org/10.1002/for.2598 - N.º de citações Web of Science®: 15 - N.º de citações Scopus: 16 - N.º de citações Google Scholar: 23
11	Grané, A., Martín-Barragan, B. & Veiga, H. (2019). Detecting outliers in multivariate volatility models: a wavelet procedure. Sort: Statistics and Operations Research Transactions, 43(2), 289?315. https://doi.org/10.2436/20.8080.02.89 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 2 - N.º de citações Google Scholar: 13
12	João Henrique Gonçalves Mazzeu, Ruiz, E. & Veiga, H. (2018). Uncertainty and density forecasts of arma models: comparison of asymptotic, bayesian, and bootstrap procedures. Journal of Economic Surveys, 32(2), 388?419. https://doi.org/10.1111/joes.12197 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 7

13	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. Journal of Energy Markets, 10(1), 79?108. https://doi.org/10.21314/JEM.2017.156 - N.º de citações Web of Science®: 12 - N.º de citações Scopus: 11 - N.º de citações Google Scholar: 20
14	Mao, X., Ruiz, E. & Veiga, H. (2017). Threshold stochastic volatility: properties and forecasting. International Journal of Forecasting, 33(4), 1105?1123. https://doi.org/10.1016/j.ijforecast.2017.07.001 - N.º de citações Web of Science®: 12 - N.º de citações Scopus: 12 - N.º de citações Google Scholar: 21
15	Bahamonde, N. & Veiga, H. (2016). A robust closed-form estimator for the GARCH(1,1) model. Journal of Statistical Computation and Simulation, 86(8), 1605?1619. https://doi.org/10.1080/00949655.2015.1077387 - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 9 - N.º de citações Google Scholar: 17
16	Galán, J. E., Veiga, H. & Wiper, M. P. (2015). Dynamic effects in inefficiency: evidence from the Colombian banking sector. European Journal of Operational Research, 240(2), 562?571. https://doi.org/10.1016/j.ejor.2014.07.005 - N.º de citações Web of Science®: 46 - N.º de citações Scopus: 42
17	Martín-Barragan, B., Ramos, S. & Veiga, H. (2015). Correlations between oil and stock markets: a wavelet-based approach. Economic Modelling, 50, 212?227. https://doi.org/10.1016/j.econmod.2015.06.010 - N.º de citações Web of Science®: 73 - N.º de citações Scopus: 75 - N.º de citações Google Scholar: 102
18	Galán, J. E., Veiga, H. & Wiper, M. P. (2014). Bayesian estimation of inefficiency heterogeneity in stochastic frontier models. Journal of Productivity Analysis, 42(1), 85?101. https://doi.org/10.1007/s11123-013-0377-4 - N.º de citações Web of Science®: 29 - N.º de citações Scopus: 25 - N.º de citações Google Scholar: 51
19	Grané, A. & Veiga, H. (2014). Outliers, GARCH-type models and risk measures: a comparison of several approaches. Journal of Empirical Finance, 26, 26?40. https://doi.org/10.1016/j.jempfin.2014.01.005 - N.º de citações Web of Science®: 20 - N.º de citações Scopus: 18 - N.º de citações Google Scholar: 31
20	Ramos, S. B. & Veiga, H. (2013). Oil price asymmetric effects: answering the puzzle in international stock markets. Energy Economics, 38(July), 136?145. https://doi.org/10.1016/j.eneco.2013.03.011 - N.º de citações Web of Science®: 90 - N.º de citações Scopus: 90 - N.º de citações Google Scholar: 171
21	Grané, A., Grané, A. & Veiga, H. (2012). Asymmetry, realised volatility and stock return risk estimates. Portuguese Economic Journal, 11(2), 147?164. https://doi.org/10.1007/s10258-012-0081-8 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 2 - N.º de citações Google Scholar: 7

22	Ramos, S. & Veiga, H. (2011). Risk factors in oil and gas industry returns: international evidence. Energy Economics, 33(3), 525?542. https://doi.org/10.1016/j.eneco.2010.10.005 - N.º de citações Web of Science®: 127 - N.º de citações Scopus: 116 - N.º de citações Google Scholar: 223
23	Grané, A., Grané, A. & Veiga, H. (2010). Wavelet-based detection of outliers in financial time series. Computational Statistics and Data Analysis, 54(11), 2580?2593. https://doi.org/10.1016/j.csda.2009.12.010 - N.º de citações Web of Science®: 76 - N.º de citações Scopus: 78 - N.º de citações Google Scholar: 141
24	Veiga, H. & Vorsatz, M. (2010). Information aggregation in experimental asset markets in the presence of a manipulator. Experimental Economics, 13(4), 379?398. https://doi.org/10.1007/s10683-010-9247-3 - N.º de citações Web of Science®: 24 - N.º de citações Scopus: 22 - N.º de citações Google Scholar: 42
25	Veiga, H. & Vorsatz, M. (2009). Price manipulation in an experimental asset market. European Economic Review, 53(3), 327?342. https://doi.org/10.1016/j.euroecorev.2008.05.004 - N.º de citações Web of Science®: 13 - N.º de citações Scopus: 12 - N.º de citações Google Scholar: 39
26	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. Computational Statistics and Data Analysis, 53(10), 3593?3600. https://doi.org/10.1016/j.csda.2009.02.026 - N.º de citações Web of Science®: 8 - N.º de citações Scopus: 7 - N.º de citações Google Scholar: 16
27	Ruiz, E. & Veiga, H. (2008). Modelling long-memory volatilities with leverage effect: A-LMSV versus FIEGARCH. Computational Statistics and Data Analysis, 52(6), 2846?2862. https://doi.org/10.1016/j.csda.2007.09.031 - N.º de citações Web of Science®: 32 - N.º de citações Scopus: 29 - N.º de citações Google Scholar: 68
28	Grané, A. & Veiga, H. (2008). Accurate minimum capital risk requirements: a comparison of several approaches. Journal of Banking and Finance, 32(11), 2482?2492. https://doi.org/10.1016/j.jbankfin.2008.05.003 - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 18
29	Veiga, H. (2007). Are feedback factors important in modeling financial data?. International Review of Finance, 7(3-4), 105?118. https://doi.org/10.1111/j.1468-2443.2007.00070.x - N.º de citações Google Scholar: 2

• Livros e Capítulos de Livros

- Capítulo de livro

1	Ramos, S., 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.), The Interrelationship Between Financial and Energy Markets (pp. 3?32). Springer. - N.º de citações Google Scholar: 8

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 Sevilha	2016