Aviso: [2026-11-06 02:15] 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.

Informação Desatualizada: A informação contida neste perfil público poderá estar desactualizada.

João Pedro Santos Sousa Pereira



Áreas de Investigação

Asset Pricing

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
University of North Carolina at Chapel Hill	Doutoramento	Finance	2004
Instituto Superior de Economia e Gestão - UTL	Mestrado	Economia Monetária e Financeira	1998
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Licenciatura	Organização e Gestão de Empresas	1995

Orientações

- **Teses de Doutoramento**

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Sofia Carla Bernardo Rodrigues	Credit Va Rand VaR in Credit Default Swaps	Inglês	Em curso	Iscte

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Joaquim Paulo Viegas Ferreira de Carvalho	Essays on Credit Rating Announcements	Inglês	Iscte	2014

• Dissertações de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Darina Ivantchova Todorova de Matos	Avaliação da Performance de Modelos de Value-at-Risk em Mercados Emergentes.	Português	Iscte	2009

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Jorge São Pedro de Cacito Gomes	Investing in U.S. Natural Gas: An exchange-traded funds approach	Inglês	Iscte	2014
2	Nuno Miguel Lourenço Graça	Asset Pricing Tests: Different Methods and Their Performance on Capm and Fama-French Three-Factor Model	Inglês	Iscte	2013
3	Miguel Primo Ganito	The Influence of Rating Notations on the Government Bond Yields of Greece, Ireland and Portugal	Inglês	Iscte	2012
4	Ricardo Jorge Ribeiro Batista	Determinantes do "Spread" Relativo ao Crédito Bancário em Portugal	Português	Iscte	2011
5	Pedro Miguel Pires Cardoso Ribeiro	Factores Explicativos dos Diferenciais das Taxas de Rendibilidade da Dívida Soberana dos Países da Área do Euro face ao Bund Alemão.	Português	Iscte	2010
6	Teresa Cristina Varela Cutelo	As Acções de Baixo Preço no Mercado Bolsista Português.	Português	Iscte	2010
7	Rita Simões Pereira	O Investimento On-Line em Portugal:que Estratégias e que Futuro?	Português	Iscte	2009

Total de Citações

Web of Science®	110
Scopus	94

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Pires, P., Pereira, J. & Martins, L. F. (2015). The empirical determinants of credit default swap spreads: a quantile regression approach. European Financial Management, 21(3), 556?589. https://doi.org/10.1111/j.1468-036X.2013.12029.x - N.º de citações Web of Science®: 43 - N.º de citações Scopus: 36 - N.º de citações Google Scholar: 83
2	Pereira, J. & Cutelo, T. (2013). Tiny prices in a tiny market: evidence from Portugal on optimal share prices. European Financial Management, 19(3), 579?598. https://doi.org/10.1111/j.1468-036X.2011.00602.x - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 3
3	Pereira, J. & Zhang, H. (2010). Stock returns and the volatility of liquidity. Journal of Financial and Quantitative Analysis, 45(4), 1077?1110. https://doi.org/10.1017/S0022109010000323 - N.º de citações Web of Science®: 49 - N.º de citações Scopus: 43
4	Ghysels, E. & Pereira, J. O. (2008). Liquidity and conditional portfolio choice: a nonparametric investigation. Journal of Empirical Finance, 15(4), 679?699. https://doi.org/10.1016/j.jempfin.2007.12.002 - N.º de citações Web of Science®: 15 - N.º de citações Scopus: 12
5	Pereira, J. & Cassola, N. (1998). Immunization under single-factor models an application to Portugal. Review of Financial Markets, 1(2), 0?0.

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

1	Pereira, J. (2013). Asset pricing with a bank risk factor. Northern Finance Association meeting, Quebec, 2013,.
2	Pereira, J. (2013). Asset pricing with a bank risk factor. Financial Management Association meeting, Chicago, 2013,.
3	Pereira, J. (2011). The complete picture of credit default swap spreads. European Financial Management Association meeting, Braga, 2011,.

4	Pereira, J. (2011). Do foreigner know better? A comparison of the performance of local and foreign mutual fund managers. Inquire UK and Inquire Europe joint spring seminar, Cambridge, UK, 2011,.
5	Pereira, J. (2011). The complete picture of credit default swap spreads. FMA European Conference, Porto, 2011,.

Cargos de Gestão Académica

Director (2010 - 2012)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças

Membro (Docente) (2010 - 2013)
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro (Docente) (2010 - 2014)
Unidade/Área: Comissão Científica