Aviso: [2024-04-23 08:12] 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.

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-IUL

• Dissertações de Mestrado

- 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-IUL	2014
2	Darina Ivantchova Todorova de Matos	Avaliação da Performance de Modelos de Value-at-Risk em Mercados Emergentes.	Português	ISCTE-IUL	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-IUL	2014
2	Nuno Miguel Lourenço Graça	Asset Pricing Tests: Different Methods and Their Performance on Capm and Fama-French Three-Factor Model	Inglês	ISCTE-IUL	2013
3	Miguel Primo Ganito	The Influence of Rating Notations on the Government Bond Yields of Greece, Ireland and Portugal	Inglês	ISCTE-IUL	2012
4	Ricardo Jorge Ribeiro Batista	Determinantes do "Spread" Relativo ao Crédito Bancário em Portugal	Português	ISCTE-IUL	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-IUL	2010
6	Teresa Cristina Varela Cutelo	As Acções de Baixo Preço no Mercado Bolsista Português.	Português	ISCTE-IUL	2010
7	Rita Simões Pereira	O Investimento On-Line em Portugal:que Estratégias e que Futuro?	Português	ISCTE-IUL	2009

Total de Citações

Web of Science®	79
Scopus	85

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 - N.º de citações Web of Science®: 31 - N.º de citações Scopus: 32 - N.º de citações Google Scholar: 81
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 - 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 - N.º de citações Web of Science®: 33 - N.º de citações Scopus: 38
4	Ghysels, E. & Pereira, J. O. (2008). Liquidity and conditional portfolio choice: a nonparametric investigation. Journal of Empirical Finance. 15 (4), 679-699 - N.º de citações Web of Science®: 12 - 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). 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.
4	Pereira, J. (2011). The complete picture of credit default swap spreads. FMA European Conference, Porto, 2011.
5	Pereira, J. (2011). The complete picture of credit default swap spreads. European Financial Management Association meeting, Braga, 2011.

Cargos de Gestão Académica

Director (2010 - 2012)
Unidade/Área: [5563] Finanças

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

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