

**Aviso:** [2026-05-11 19:15] 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 desatualizada.

## 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®	108
Scopus	93

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	<p>Pires, P., Pereira, J. &amp; Martins, L. F. (2015). The empirical determinants of credit default swap spreads: a quantile regression approach. <i>European Financial Management</i>. 21 (3), 556-589</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- N.º de citações Web of Science®: 42</li><li>- N.º de citações Scopus: 36</li><li>- N.º de citações Google Scholar: 82</li></ul>
2	<p>Pereira, J. &amp; Cutelo, T. (2013). Tiny prices in a tiny market: evidence from Portugal on optimal share prices. <i>European Financial Management</i>. 19 (3), 579-598</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- N.º de citações Web of Science®: 3</li><li>- N.º de citações Scopus: 3</li></ul>
3	<p>Pereira, J. &amp; Zhang, H. (2010). Stock returns and the volatility of liquidity. <i>Journal of Financial and Quantitative Analysis</i>. 45 (4), 1077-1110</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- N.º de citações Web of Science®: 48</li><li>- N.º de citações Scopus: 42</li></ul>
4	<p>Ghysels, E. &amp; Pereira, J. O. (2008). Liquidity and conditional portfolio choice: a nonparametric investigation. <i>Journal of Empirical Finance</i>. 15 (4), 679-699</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- N.º de citações Web of Science®: 15</li><li>- N.º de citações Scopus: 12</li></ul>
5	<p>Pereira, J. &amp; Cassola, N. (1998). Immunization under single-factor models an application to Portugal. <i>Review of Financial Markets</i>. 1 (2), 0-0</p>

### • Conferências/Workshops e Comunicações

#### - Comunicação em evento científico

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

4	Pereira, J. (2011). Do foreigners 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