

Aviso: [2024-11-19 11:17] 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.

Luis Oliveira

Professor Auxiliar

Departamento de Finanças (IBS)

Investigador Associado sem Financiamento FCT

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)

Contactos

| | |
|-----------------|----------------------------|
| E-mail | luis.oliveira@iscte-iul.pt |
| Gabinete | D5.25 |
| Telefone | 217650521 (Ext: 220762) |
| Cacifo | 375 |

Áreas de Investigação

Mercados Financeiros, Gestão de Risco de Mercado, Gestão de Risco Taxa de Juro, Derivados Financeiros

Qualificações Académicas

| Universidade/Instituição | Tipo | Curso | Período |
|---|--------------|----------|---------|
| ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa | Doutoramento | Gestão | 2007 |
| ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa | Mestrado | Finanças | 2002 |
| Instituto Superior de Economia e Gestão - UTL | Licenciatura | Economia | 1990 |

Outras Atividades Profissionais

| Período | Tipo de Atividade | Descrição da Atividade | Link para mais informação |
|-------------|--|--|---------------------------|
| 2018 - 2020 | Experiências documentadas e continuadas de educação profissional | Formador na Nova-IMS em programas de formação profissional e executive masters | -- |
| 2002 - 2015 | Experiências documentadas e continuadas de educação profissional | Formador do CEMAF/ISCTE e INDEG/ISCTE | -- |
| 2001 - 2014 | Atividades de consultoria | CEMAF/INDEG Consultor Sénior | -- |
| 1991 - 2000 | Trabalho profissional regular | Bolsa de Valores de Lisboa - Técnico Superior e Coordenador-Área de Estudos e Mercados | -- |
| 1988 - 1991 | Trabalho profissional regular | Montepio Geral-Caixa Económica de Lisboa - Técnico Superior Departamento Financeiro - Planeamento e Controlo de Gestão Técnico | -- |

Atividades Letivas

| Ano Letivo | Sem. | Nome da Unidade Curricular | Curso(s) | Coord |
|------------|------|-------------------------------|---|-------|
| 2024/2025 | 2º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2024/2025 | 2º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2023/2024 | 1º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2023/2024 | 1º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |

| | | | | |
|-----------|----|-------------------------------|---|-----|
| 2022/2023 | 1º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2022/2023 | 1º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2021/2022 | 1º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2021/2022 | 1º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Não |
| 2020/2021 | 2º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2020/2021 | 1º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2020/2021 | 1º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Não |
| 2019/2020 | 2º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2019/2020 | 1º | Finanças de Empresa | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão; | Sim |
| 2019/2020 | 1º | Gestão de Activos Financeiros | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|--|-------------------|---------------|--------|-------------|------------------|
|--|-------------------|---------------|--------|-------------|------------------|

| | | | | | |
|---|-----------------------------------|--|--------|-----------|------|
| 1 | Pedro Miguel Barreirão Ferreira | Empirical Essays on Portfolio Management | Inglês | ISCTE-IUL | 2022 |
| 2 | Cláudia Patrícia Gonçalves Simões | Empirical Essays on Portfolio Immunization | -- | ISCTE-IUL | 2017 |

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Estado | Instituição |
|---|-------------------|---------------------------------------|--------|----------|-------------|
| 1 | Diogo Pais Canoa | Equity Research - The Home Depot, Inc | -- | Em curso | ISCTE-IUL |

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|----|--|---|-----------|-------------|------------------|
| 1 | João Pedro e Sousa e Brito Tapada | O Impacto de Eventos Políticos no Mercado de Capitais Português | Inglês | ISCTE-IUL | 2022 |
| 2 | Maria Isabel Pessoa Jorge de Oudinot Larcher | Determinantes dos Spreads de Crédito Soberanos nos Países Periféricos da Zona Euro | Português | ISCTE-IUL | 2017 |
| 3 | Luis Miguel Gonçalves Oliveira Palma Carlos | Predicting Successful per Reorganizations - Testing the applicability of Altman Z-Score on Portuguese Companies | Inglês | ISCTE-IUL | 2017 |
| 4 | José Pedro Figueiredo de Magalhães | Countercyclical Capital Buffer | Inglês | ISCTE-IUL | 2017 |
| 5 | Safiya Ahmad | The impact of Hedging on a Portuguese Non-Financial Firm | Inglês | ISCTE-IUL | 2017 |
| 6 | Marta Sofia Pepe Ferreira | Decomposição da Cross-Sectional Volatility no Mercado de Ações Português | Português | ISCTE-IUL | 2016 |
| 7 | Tomás Coutinho Grosso de Oliveira Salen | Market Timing and Selectivity: Na Empirical Investigation of European Mutual Fund Performance | Inglês | ISCTE-IUL | 2016 |
| 8 | Pedro Manuel de Sousa Carita | A importância da literacia financeira nas decisões de investimento | Português | ISCTE-IUL | 2016 |
| 9 | Punit Limji Panchá | Financiamento através do Crédito Comercial: Evidência nas (Maiores e Melhores) PME Portuguesas | Português | ISCTE-IUL | 2016 |
| 10 | João Pedro Martelo Ramos | Tracking Ability of Global Emerging Markets Exchange Traded Funds | Inglês | ISCTE-IUL | 2015 |
| 11 | Ana Rita dos Santos Matilde | The Hadloven Effect in European Evisty Mutual Funds | Inglês | ISCTE-IUL | 2014 |

| | | | | | |
|----|---|---|-----------|-----------|------|
| 12 | Carolina Maria Henriques Neves Vieira | Consistência da Performance dos Fundos de Gestão Activa de Ações Europeias | Português | ISCTE-IUL | 2014 |
| 13 | João Paulo Matos Heitor Canas | Imunização do Risco de Taxa de Juro: Um ensaio com obrigações do tesouro português | Português | ISCTE-IUL | 2013 |
| 14 | Cláudia Sofia Gouveia Fonseca | Gestão Activa Versus Gestão Passiva: Análise Comparativa da Performance dos Exchange Traded Funds | Português | ISCTE-IUL | 2012 |
| 15 | Ana Alexandra Afonso Martins | Eficiência dos Mercados Accionistas Europeus - Efeito Dia-da-Semana | Português | ISCTE-IUL | 2012 |
| 16 | Marta Rodrigues da Silva Martins de Paula | Impacto da Crise Sub-Prime no Sector Bancário Português. | Português | ISCTE-IUL | 2009 |

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|----|----------------------------------|---|-----------|-------------|------------------|
| 1 | Luís Gonçalo Baptista Pires | O Impacto das Taxas de Juros Negativas nos Custos de Financiamento de uma Empresa | Inglês | ISCTE-IUL | 2019 |
| 2 | Tiago Manuel Sousa Oliveirinha | Interest Rate Swaps: Pratical Issues, Corporate use and Regulation | Inglês | ISCTE-IUL | 2017 |
| 3 | Ana Sofia Rodrigues Matos | Evaluation of EGF: A privatization case | Inglês | ISCTE-IUL | 2013 |
| 4 | Pedro Miguel Gião Folgado | Carteiras de variância mínima no Mercado de Acções Português | Português | ISCTE-IUL | 2013 |
| 5 | Rui Elias de Faria | Optimização de Riscos Financeiros em Fundos de Pensões | Português | ISCTE-IUL | 2013 |
| 6 | Ana Sofia Fonseca Piedade | Estratégias de Imunização do risco de taxa de juro - Aplicação aos Balanço das Instituições Financeiras | Português | ISCTE-IUL | 2012 |
| 7 | Liliana Brandão Jerónimo | All that Glitters is not Gold: Diversification Strategies in Portofolio Management | Inglês | ISCTE-IUL | 2012 |
| 8 | Joana Bruno Vieira | Modelling Volatility: Na assessment of the value at risk approach | Inglês | ISCTE-IUL | 2012 |
| 9 | Jamila Bárbara Madeira e Madeira | O Impacte dos Mercados de Capitais na Evolução dos Determinantes Sociopolíticos | Português | ISCTE-IUL | 2011 |
| 10 | Gonçalo Paiva da Cunha Lima | | -- | ISCTE-IUL | 2011 |

| | | | | | |
|----|--|--|-----------|-----------|------|
| 11 | Patrícia Afonso Correia Vargas Tavares | Impacto da Política Monetária nas Principais Variáveis Macroeconómicas em Portugal | Português | ISCTE-IUL | 2011 |
| 12 | Teresa Mariana Cardeira Martins | Reverse Mortgage em Portugal uma Opção Viável? | -- | ISCTE-IUL | 2011 |
| 13 | Tiago Miguel Teixeira Carrzedo | The Halloween Effect in European Sectors. | -- | ISCTE-IUL | 2011 |
| 14 | Ramiro Manuel Marques Loureiro | | -- | ISCTE-IUL | 2011 |
| 15 | Milene Clementina Morais Costa | Eventos Internacionais e os Impactos nos Mercados Financeiros | Português | ISCTE-IUL | 2011 |
| 16 | Cláudia Pereira Correia | A Relação entre o Mercado de Obrigações e de Credit Default Swaps: O impacto da liquidez e do risco de crédito da contraparte nos preços dos CDS e da dívida pública emitida por países de mercados emergentes | Português | ISCTE-IUL | 2011 |
| 17 | Gérson Ramiro Gomes Carola | Caracterização da Evolução da Indústria de Fundos de Investimento Mobiliário em Portugal. | Português | ISCTE-IUL | 2010 |
| 18 | Ricardo Humberto Dias Jorge | Investir em Acções segundo Warren Buffett: O caso Português. | Português | ISCTE-IUL | 2010 |
| 19 | Francisco José Garcia dos Santos | Percepção dos Risco Investidores Fundos de Investimento. | Português | ISCTE-IUL | 2010 |
| 20 | Paulo José Morgado Lopes Gomes | A Titularização de Créditos como Meio de Financiamento. | Português | ISCTE-IUL | 2010 |
| 21 | Nuno Alexandre da Graça Tomás | Investimento Imobiliário no Brasil. | Português | ISCTE-IUL | 2010 |
| 22 | Paula Andreia de Carvalho Patrão de Sá | OPA do BCP sobre o BPI: Impacto na Negociação Bolsista | Português | ISCTE-IUL | 2010 |
| 23 | Pedro Miguel Pedrosa Gomes dos Santos | A Inevitável Fusão entre a Sonaecom e a Zon. | Português | ISCTE-IUL | 2009 |

Total de Citações

| | |
|------------------------|----|
| Web of Science® | 96 |
| Scopus | 90 |

Publicações

- **Revistas Científicas**
 - Artigo em revista científica

| | |
|---|---|
| 1 | <p>Simões, C, Oliveira, L. & Bravo, J. M. (2021). Immunization strategies for funding multiple inflation-linked retirement income benefits. <i>Risks</i>. 9 (4)</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 10</p> <p>- N.º de citações Scopus: 11</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 10</p> |
| 2 | <p>Oliveira, L., Salen, T., Curto, J. D. & Ferreira, N. (2019). Market timing and selectivity: an empirical investigation of European mutual fund performance. <i>International Journal of Economics and Finance</i>. 11 (2)</p> |
| 3 | <p>Curto, J. D., Oliveira, L. & Matilde, A. R. (2018). The Halloween effect in European equity mutual funds. <i>The Open Journal of Economics and Finance</i>. 2, 20-35</p> |
| 4 | <p>Carrazedo, T., Curto, J. & Oliveira, L. (2016). The Halloween effect in European sectors. <i>Research in International Business and Finance</i>. 37, 489-500</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 17</p> <p>- N.º de citações Scopus: 16</p> |
| 5 | <p>Oliveira, L., Nunes, J. & Malcato, L. (2014). The performance of deterministic and stochastic interest rate risk measures: another question of dimensions?. <i>Portuguese Economic Journal</i>. 13 (3), 141-165</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 3</p> <p>- N.º de citações Scopus: 3</p> |
| 6 | <p>Martins, A. & Oliveira, L. (2013). Efeito dia da semana em mercados acionistas internacionais. <i>Revista Portuguesa e Brasileira de Gestão</i>. 12 (2), 14-29</p> |
| 7 | <p>Oliveira, L., Curto, J. D. & Nunes, J. P. (2012). The determinants of sovereign credit spread changes in the Eurozone. <i>Journal of International Financial Markets, Institutions & Money</i>. 22 (2), 278-304</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 59</p> <p>- N.º de citações Scopus: 60</p> |
| 8 | <p>Nunes, J. P. V. & Oliveira, L. (2007). Multifactor and analytical valuation of treasury bond futures with an embedded quality option. <i>Journal of Futures Markets</i>. 27 (3), 275-303</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 7</p> |

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

| | |
|---|---|
| 1 | <p>Oliveira, L., Barroso, C., Mota, A., João Nunes, Inácio, P. & Miguel A. Ferreira (2020). <i>Finanças da Empresa: teoria e prática</i>. Lisboa. Sílabo.</p> |
| 2 | <p>Oliveira, L., Laureano, L. & Inácio, P. (2019). <i>Mercados e Instrumentos Financeiros</i>. Lisboa. Sílabo.</p> |
| 3 | <p>Miguel, A., Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Lourenço, J., Oliveira, L....Alpalhão, R. (2019). <i>Investimentos Financeiros - Teoria e Prática</i>. Lisboa. Sílabo.</p> |
| 4 | <p>Barroso, C., Mota, A., Oliveira, L., Nunes, J. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática (edição revista e aumentada)</i>. Lisboa. Sílabo.</p> |
| 5 | <p>Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L., Ferreira, M. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i>. Lisboa. Sílabo.</p> |

| | |
|---|--|
| 6 | Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L. & Ferreira, M. (2012). Investimentos Financeiros: teoria e prática. Portugal . Edições Sílabo . |
| 7 | Oliveira, L., Mota, A., Barroso, C. & Nunes, J. (2009). Investimentos Financeiros: Teoria e prática. Lisboa/Portugal. Edições Sílabo. |

- Editor de livro

| | |
|---|--|
| 1 | Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Miguel A. Ferreira & Oliveira, L. (2012). Finanças da Empresa: Teoria e Prática . Lisboa/Portugal. Sílabo. |
| 2 | Oliveira, L., Barroso, C., Nunes, J. & Miguel A. Ferreira (2011). Finanças da Empresa Teoria e Prática. Portugal. Sílabo. |

• Outras Publicações

- Working paper

| | |
|---|---|
| 1 | Oliveira, L., Gonçalves, V. & Tapada, J. (2023). The impact of political events on the Portuguese Stock Market behaviour. SSRN. |
|---|---|

- Artigo sem avaliação científica

| | |
|---|---|
| 1 | Oliveira, L. & Nunes, J. (2012). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. SSRN. 0-0 |
| 2 | Oliveira, L. & Nunes, J. (2008). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures . SSRN. 0-0 |

- Outras publicações

| | |
|---|--|
| 1 | Curto, J. D., Oliveira, L. & Matilde, A. R. (2017). The halloween effect in european equity mutual funds. The Open Journal of Economics and Finance. 1, 1-16 |
|---|--|

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

| | |
|---|---|
| 1 | Oliveira, L., Inácio, P. & Oliveira, C. (2018). ECONOMIC VALUE ADDED ASSESSMENT APPLIED TO THE PORTUGUESE SME DURING THE CRISIS PERIOD. 10th Portuguese Finance Network Conference. |
| 2 | Simões, C, Oliveira, L. & Bravo, J. (2018). Multi Liability Immunization with the M-Absolute Model: an Approach to the 21st Century U.S. Bond Market. 10th Portuguese Finance Network Conference. |
| 3 | Oliveira, L., Matilde, A. & Curto, J. (2015). Halloween Effect in European Mutual Funds. 15th EBES Conference. |
| 4 | Oliveira, L., João Nunes & Malcato, L. (2014). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimensions?. PFN 8th Finance Conference. |

| | |
|---|--|
| 5 | Oliveira, L., Curto, J. & Carrazedo, T. (2014). THE HALLOWEEN EFFECT IN EUROPEAN SECTORS. 8th annual meeting of the PEJ. |
| 6 | Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. 7th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal. |
| 7 | Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. FMA Europe 2013 Meeting. |
| 8 | Oliveira, L. (2012). The Halloween Effect in European Sectors. 7th Finance Conference of the Portuguese Finance Network. |
| 9 | Oliveira, L. (2010). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate risk Measures. 6th Portuguese Finance Network Conference. |

Cargos de Gestão Académica

Director (2011 - 2013)
Unidade/Área: Licenciatura em Finanças e Contabilidade

Responsável (2011 - 2014)
Unidade/Área: Escola de Gestão

Director (2010 - 2011)
Unidade/Área: Licenciatura em Finanças e Contabilidade

Sub-diretor (2010 - 2013)
Unidade/Área: Departamento de Finanças