

Aviso: [2024-12-22 02:32] 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;	Sim
2024/2025	2º	Gestão de Activos Financeiros	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2024/2025	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Sim
2024/2025	1º	Gestão de Activos Financeiros		Sim
2023/2024	2º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2023/2024	2º	Gestão de Activos Financeiros	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2023/2024	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Sim
2023/2024	1º	Gestão de Activos Financeiros		Sim
2022/2023	2º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2022/2023	2º	Gestão de Activos Financeiros	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2022/2023	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Sim
2022/2023	1º	Gestão de Activos Financeiros		Sim

2021/2022	2º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Sim
2021/2022	2º	Gestão de Activos Financeiros	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2021/2022	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Sim
2021/2022	1º	Gestão de Activos Financeiros		Sim
2020/2021	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2020/2021	2º	Finanças de Empresa		Sim
2020/2021	2º	Gestão de Activos Financeiros	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2020/2021	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Sim
2020/2021	1º	Gestão de Activos Financeiros		Sim
2019/2020	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2019/2020	2º	Finanças de Empresa		Sim
2019/2020	2º	Gestão de Activos Financeiros	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2019/2020	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Sim
2019/2020	1º	Gestão de Activos Financeiros		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 Ativa 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 Carrazedo	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®	99
Scopus	93

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: 12</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 13</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	Carrazedo, T., Curto, J. & Oliveira, L. (2016). The Halloween effect in European sectors. Research in International Business and Finance. 37, 489-500 - N.º de citações Web of Science®: 18 - N.º de citações Scopus: 17
5	Oliveira, L., Nunes, J. & Malcato, L. (2014). The performance of deterministic and stochastic interest rate risk measures: another question of dimensions?. Portuguese Economic Journal. 13 (3), 141-165 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 3
6	Martins, A. & Oliveira, L. (2013). Efeito dia da semana em mercados acionistas internacionais. Revista Portuguesa e Brasileira de Gestão. 12 (2), 14-29
7	Oliveira, L., Curto, J. D. & Nunes, J. P. (2012). The determinants of sovereign credit spread changes in the Eurozone. Journal of International Financial Markets, Institutions & Money. 22 (2), 278-304 - N.º de citações Web of Science®: 61 - N.º de citações Scopus: 61
8	Nunes, J. P. V. & Oliveira, L. (2007). Multifactor and analytical valuation of treasury bond futures with an embedded quality option. Journal of Futures Markets. 27 (3), 275-303 - N.º de citações Web of Science®: 7

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

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