

**Aviso:** [2026-04-28 16:35] 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.

## Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira

### Professor Auxiliar

BRU-Iscte - Business Research Unit  
Departamento de Métodos Quantitativos (IBS)



## Contactos

<b>E-mail</b>	nuno.ferreira@iscte-iul.pt
<b>Gabinete</b>	AA1.08
<b>Telefone</b>	217650211 (Ext: 220512)
<b>Cacifo</b>	171

## Áreas de Investigação

Econometria dos Mercados Financeiros
Modelos de transição suaves
Modelos Global VAR
Cointegração de series temporais
Data Science com Aplicações em Mercados Financeiros

## Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Doutoramento	Gestão	2005
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Mestrado	Ciências Empresariais	1997
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Licenciatura	Organização e Gestão de Empresas	1994

## Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord
2017/2018	1º	Econometria dos Mercados Financeiros		Não
2016/2017	2º	Complementos de Matemática		Não
2014/2015	2º	Matemática II	Licenciatura em Economia;	Não
2014/2015	1º	Matemática		Não
2013/2014	2º	Optimização		Não
2013/2014	1º	Matemática		Não

## Orientações

### • Teses de Doutoramento

#### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	José Nuno Teixeira de Abreu de Albuquerque Sacadura	Essays on European Banks Dividend Policy and Ownership - An Agency Theory Perspective	Inglês	Iscte	2024

### • Dissertações de Mestrado

#### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Bernardo Maria Mestre Acácio Lopes	Mercado Bolsista e a sua Integração para os Mercados da Zona Euro Mercado Bolsista e a sua Integração para os Mercados da Zona Euro	Português	Iscte	2017

2	Tomás Coutinho Grosso de Oliveira Salen	Market Timing and Selectivity: Na Empirical Investigation of European Mutual Fund Performance	Inglês	Iscte	2016
3	Diogo Lopes Pinheiro	Fusões e Aquisições Transnacionais: uma análise empírica do caso Arcelor Mittal	Português	Iscte	2012

## • Projetos Finais de Mestrado

### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Frederico Freire de Barbosa Bacelar de Meireles	Qual o Impacto do Serviço M4O no Mercado das Telecomunicações e na Liderança da PT?	Português	Iscte	2015

## Total de Citações

Web of Science®	49
Scopus	30

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	Ferreira, N. B. (2022). Untangling the inefficiency of hotel industry: The Portuguese Teixeira Duarte hotel chain analysis. Archives of Business Research. 10 (8), 133-140
2	Menezes, R., Ferreira, N. B., Souza, A. M. & Souza, F. M. (2020). Smooth transition regression models: theory and applications in jmulti. Ciencia e Natura. 18 (42), 1-28
3	Oliveira, L., Salen, T., Curto, J. D. & Ferreira, N. (2019). Market timing and selectivity: an empirical investigation of European mutual fund performance. International Journal of Economics and Finance. 11 (2) - N.º de citações Web of Science®: 7
4	Oliveira, M.M., AMC, JW, Vera Miguéis, Ferreira, N. B. & Miguel Gaspar (2019). Forecasting bivalve landings with multiple regression and data mining techniques: The case of the Portuguese Artisanal Dredge Fleet. Marine Policy. 110-118
5	Ferreira, N. (2018). Macro-financial linkages between emergent and sustainable economies in a context of the European sovereign debt crisis. Archives of Business Research. 6 (8), 109-121

6	Oliveira, M. M., Camanho, A. S., Walden, J. B., Miguéis, V. L., Ferreira, N. B. & Gaspar, M. B. (2017). Forecasting bivalve landings with multiple regression and data mining techniques: the case of the Portuguese artisanal dredge fleet. <i>Marine Policy</i> . 84, 110-118 - N.º de citações Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 6
7	Ferreira, N. B. & Oliveira, M. M. (2016). Portfolio efficiency analysis with SFA: the case of PSI-20 companies. <i>Applied Economics</i> . 48 (1), 1-6 - N.º de citações Web of Science®: 7 - N.º de citações Scopus: 4
8	Ferreira, N. & Souza, A. M. (2015). Efficiency in stock markets with DEA: evidence from PSI20. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 5 (1), 861-865
9	Ferreira, N. B., Souza, F. M. & Souza, A. (2014). PSI-20 portfolio efficiency analysis with SFA. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 4 (3), 785-789
10	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Bentes, S. (2014). Cointegration and Structural Breaks in the EU Sovereign Debt Crisis. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 4 (1), 680-690
11	Ferreira, N. B., Rocha, L., Souza, A. & Santos, E. (2014). Box-Jenkins and volatility models for Brazilian 'Selic' interest and currency rates. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 4 (3), 766-773
12	Bentes, S. & Ferreira, N. B. (2014). Modeling long memory in the EU stock market: evidence from the STOXX 50 returns. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 4 (3), 778-784
13	Ferreira, N. B. & Oliveira, M. M. (2014). An analysis of equity markets cointegration in the european sovereign debt crisis. <i>Open Journal of Finance</i> . 1 (1), 40-48
14	Ferreira, N., Menezes, R. & Bentes, S. (2013). Globalization, regime-switching, and EU stock markets: the impact of the sovereign debt crises. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 3 (3), 556-562
15	Bentes, S.R., Menezes, R. & Ferreira, N.B. (2013). On the asymmetric behaviour of stock market volatility: evidence from three countries. <i>International Journal of Academic Research</i> . 5 (4), 24-32
16	Ferreira, N., Menezes, R. & Bentes, S. (2013). Cointegration and structural breaks in the PIIGS economies. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 3 (4), 611-617
17	Ferreira, N., Menezes, R. & Oliveira, M. M. (2013). Structural breaks and cointegration analysis in the EU developed markets. <i>International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences</i> . 3 (4), 652-661
18	Souza, A., Souza, F., Ferreira, N. B. & Menezes, R. (2011). Electrical energy supply for Rio Grande do Sul, Brazil, using forecast combination of weighted eigenvalues. <i>Gestão da Produção, Operações e Sistemas</i> . 6 (3), 23-39
19	Souza, A. M., Souza, F. M., Ferreira, N. & Menezes, R. (2011). Eletrical energy supply for Rio Grande do Sul, Brazil, using forecast combination of weighted eigenvalues. <i>Gestão da Produção, Operações e Sistemas</i> . 3, 23-41

20	<p>Ferreira, N. B., Menezes, R. &amp; Mendes, D. A. (2007). Asymmetric conditional volatility in international stock markets. <i>Physica A</i>. 382 (1), 73-80</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 16</p> <p>- N.º de citações Scopus: 10</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 30</p>
21	<p>Menezes, R., Ferreira, N.B. &amp; Mendes, D.A. (2006). Co-movements and asymmetric volatility in the Portuguese and U.S. stock markets. <i>Nonlinear Dynamics</i>. 44 (1-4), 359-366</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 13</p> <p>- N.º de citações Scopus: 10</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 19</p>

## • Conferências/Workshops e Comunicações

### - Publicação em atas de evento científico

1	<p>Ferreira, N. B., Mendes, D. &amp; Mendes, V. (2024). Can higher data frequency lead to more accurate stock market predictions: Nasdaq 100 and DAX cases. In Ana Colubi, Erricos J. Kontoghiorghes and Manfred Deistler (Ed.), <i>Programme and Abstracts: CFE-CMStatistics 2024</i>. Londres: Ecosta Econometrics and Statistics.</p>
2	<p>Mendes, D. A., Ferreira, N. B. &amp; Mendes, V. (2023). Data frequency and forecast performance for stock markets: A deep learning approach for DAX index. In Rocío Martínez-Torres, Sergio Toral (Ed.), <i>Proceedings of the 5th International Conference on Advanced Research Methods and Analytics (CARMA2023)</i>. (pp. 39-39). Sevilha: Editorial Universitat Politècnica de València.</p>
3	<p>Ferreira, N. B. (2020). Comparative multivariate forecast performance for the G7 stock markets: VECM models vs deep learning LSTM neural networks. In Universidade Politècnica de Valencia (Ed.), <i>International Conference on Advanced Research Methods and Analytics</i>. (pp. 163-171). Valencia</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p>
4	<p>Ferreira, N. B. (2016). Insights into portuguese stock market efficiency using DEA. In Roslind X. Thambusamy, Melis Y. Minas, Zafer Bekirogullari (Ed.), <i>The European Proceedings of Social and Behavioural Sciences</i>. (pp. 367-373). Selangor: Future Academy.</p>
5	<p>Ferreira, N. &amp; Oliveira, M.M. (2015). Untangling hotel industry's inefficiency: An SFA approach applied to a renowned Portuguese hotel chain. In <i>9th International Conference on Computational and Financial Econometrics: Book of abstracts</i>. (pp. 216-216). Londres: CFE and CMStatistics networks.</p>
6	<p>Ferreira, N. B. &amp; Menezes, R. (2014). Efficiency assessment of the PSI-20 enterprises using Stochastic Frontier Analysis. In <i>Sixth Annual American Business Research Conference</i>. New York</p>
7	<p>Mendes, D. A., Mendes, V., Ferreira, N. B. &amp; Menezes, R. (2010). Symbolic shadowing and the computation of entropy for observed time series. In Misako Takayasu, Tsutomu Watanabe, Hideki Takayasu (Ed.), <i>Econophysics Approaches to Large-Scale Business Data and Financial Crisis</i>. (pp. 227-246). Tokyo: Springer Japan.</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 1</p>

### - Comunicação em evento científico

1	<p>Ferreira, N. B., Mendes, D. A. &amp; Mendes, V. (2024). Can higher data frequency lead to more accurate stock market predictions: NASDAQ 100 and DAX cases. <i>18th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2024)</i>.</p>
---	---

2	Ferreira, N. B., Mendes, D. A. & Mendes, V. (2024). Does data frequency mean better stock market forecasting performance? The German and US case study. 1st Artificial Intelligence in Finance Conference (AIIFC) .
3	Mendes, D. A., Mendes, V. & Ferreira, N. B. (2023). Multivariate forecast for financial stock prices: A hybrid VAR-LSTM deep learning model. COMPSTAT 2023.
4	Mendes, D. A., Ferreira, N. B. & Mendes, V. (2023). Could data frequency imply better forecast performance for stock markets? A case study for G7 economies. 9th International conference on Time Series and Forecasting.
5	Mendes, D. A., Ferreira, N. B. & Mendes, V. (2023). Could data frequency imply better forecast performance for stock markets? A case study for DAX index Stock Market. CARMA23.
6	Mendes, D. A., Mendes, V., Lopes, T. & Ferreira, N. B. (2021). Multivariate forecast for the G7 stock markets: a hybrid VECM-LSTM deep learning model. CCS2021-SATELLITE ON ECONOPHYSICS 2021.
7	Mendes, D. A., Ferreira, N. B. & Mendes, V. (2020). A comparative time series analysis to improve US Stock Market forecast performance by using univariate and multivariate deep learning algorithms . CARMA20.
8	Ferreira, N. B. (2020). A comparative time series frequency analysis to improve US Stock Market forecast performance by using deep learning algorithms. NEW YORK CITY INTERNATIONAL ACADEMIC CONFERENCE ON BUSINESS & ECONOMICS.
9	Mendes, D. A., Ferreira, N. B. & Mendes, V. (2019). Could the supply of a chain big data analytics market register a better forecast performance for the Stock Markets? – A comparative software analysis. ITISE 2019.
10	Manuela Oliveira, AMC, JW, Vera Miguéis , Ferreira, N. B. & Miguel Gaspar (2017). Forecasting of bivalve landings with multiple regression and data mining: The case of the Portuguese artisanal dredge fleet. 21st Conference of the International Federation of Operational Research Societies.
11	Ferreira, N. B. (2016). Insights Into Portuguese Stock Market Efficiency Using DEA. BE-ci 2016 International Conference on Business & Economics.
12	Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2016). Insights Into Portuguese Stock Market Efficiency Using DEA. 2016 - BE-ci International Conference on Business & Economics .
13	Ferreira, N. B., Manuela Oliveira, JW & AMC (2016). Predicting revenue efficiency of the Portuguese artisanal dredge fishery using external factors. TBTI Symposium on European Small - Scale Fisheries and Global Linkages June 29-July 1.
14	Ferreira, N. B. & Manuela Oliveira (2016). Exploring Linkages of the Emergent Economies under a European Sovereign Debt Crisis Context. 8th Annual American Business Research Conference.
15	Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2015). Untangling hotel industry's inefficiency: an SFA approach applied to a renowned Portuguese hotel chain. 9th International Conference on Computational and Financial Econometrics London, UK .
16	Ferreira, N. B. & Menezes, R. (2014). Efficiency assessment of the PSI-20 enterprises using Stochastic Frontier Analysis. 6th Annual American Business Research Conference.
17	Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2014). Portfolio technical efficiency assessment with DEA: the case of the PSI-20 enterprises. 8th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2014).

18	Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2014). Nonlinearities in the EU sovereign debt crisis. International work-conference on Time Series.
19	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Oliveira, M.M. (2013). Cointegration and structural breaks in the EU Sovereign Debt Crisis. Finance and Economics Conference.
20	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Bentes, S. (2012). EU severe debt crisis: strengthened links between interest rates and stock market returns. 6th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE12).
21	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Mendes, D. A. (2011). Regime-Switching Modelling of Globalization Analysis in the Context of Stock Markets under Sovereign Debt Crisis. Finance and Economics Conference.
22	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Mendes, D. A. (2009). Regime-Switching modelling of globalization analysis in International stock markets. Finance and Economics Conference.

## • Outras Publicações

### - Outras publicações

1	Ferreira, N. B. (2019). Doctorial Consortium. Doctoral Consortium CEFAGE.
---	---

## Prémios

Certificado do melhor paper do Jornal da Conferencia 8th Annual American Business Research Conference (2016)