

Aviso: [2021-04-16 09:08] 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.

Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira

Professor Auxiliar

Departamento de Métodos Quantitativos para Gestão e Economia (IBS)

Investigador Associado

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)
[Grupo de Data Analytics]



Contactos

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

Áreas de Investigação

Econometria dos Mercados Financeiros
Modelos de transição suaves
Modelos Global VAR
Cointegração de series temporais

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

Orientações

• Dissertações de Mestrado

- Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Orientador	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-IUL	2017
2	Orientador	Tomás Coutinho Grosso de Oliveira Salen	Market Timing and Selectivity: Na Empirical Investigation of European Mutual Fund Performance	Inglês	ISCTE-IUL	2016
3	Orientador	Diogo Lopes Pinheiro	Fusões e Aquisições Transnacionais: uma análise empírica do caso Arcelor Mittal	Português	ISCTE-IUL	2012

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

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

Total de Citações

Web of Science®	22
Scopus	24

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	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)
2	Ferreira, N. (2018). Macro-financial linkages between emergent and sustainable economies in a context of the European sovereign debt crisis. <i>Archives of Business Research</i> . 6 (8), 109-121
3	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®: 2 - N.º de citações Scopus: 5
4	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®: 2 - N.º de citações Scopus: 2
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
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	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

16	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Mendes, D. A. (2007). Asymmetric conditional volatility in international stock markets. <i>Physica A</i> . 382 (1), 73-80 - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 9
17	Menezes, R., Ferreira, N.B. & 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 - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 8

- Artigo de revisão

1	Mendes, D. A., Ferreira, N. B. & Mendes, V. (2020). Comparative multivariate forecast performance for the G7 Stock Markets: VECM Models vs deep learning LSTM neural networks. <i>Actas da 3rd International Conference on Advanced Research Methods and Analytics</i> .
---	--

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Publicação em atas de evento científico

1	Ferreira, N. B. (2020). Comparative multivariate forecast performance for the G7 stock markets: VECM models vs deep learning LSTM neural networks. In Universidade Politécnica de Valencia (Ed.), <i>International Conference on Advanced Research Methods and Analytics</i> . (pp. 163-171). Valencia
2	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.
3	Ferreira, N. B. & 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</i> London, UK. (pp. 216-216). Londres
4	Ferreira, N. B. & 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
5	Mendes, D. A., Mendes, V., Ferreira, N. B. & 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.

- Comunicação em evento científico

1	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 . <i>CARMA20</i> .
2	Ferreira, N. B. (2020). A comparative time series frequency analysis to improve US Stock Market forecast performance by using deep learning algorithms. <i>NEW YORK CITY INTERNATIONAL ACADEMIC CONFERENCE ON BUSINESS & ECONOMICS</i> .
3	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. <i>ITISE 2019</i> .

4	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.
5	Ferreira, N. B. (2016). Insights Into Portuguese Stock Market Efficiency Using DEA. BE-ci 2016 International Conference on Business & Economics.
6	Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2016). Insights Into Portuguese Stock Market Efficiency Using DEA. 2016 - BE-ci International Conference on Business & Economics .
7	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.
8	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.
9	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 .
10	Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2014). Nonlinearities in the EU sovereign debt crisis. International work-conference on Time Series.
11	Ferreira, N. B. & Menezes, R. (2014). Efficiency assessment of the PSI-20 enterprises using Stochastic Frontier Analysis. 6th Annual American Business Research Conference.
12	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).
13	Ferreira, N. B., Menezes, R. & Oliveira, M.M. (2013). Cointegration and structural breaks in the EU Sovereign Debt Crisis. Finance and Economics Conference.
14	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).
15	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.
16	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.
---	---

