

Aviso: [2024-12-31 00:39] 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.

Paulo Viegas de Carvalho

Professor Auxiliar Convidado

Departamento de Finanças (IBS)

Investigador IntegradoBRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)
[Grupo de Finanças]

Contactos

E-mail

Paulo_Viegas_Carvalho@iscte-iul.pt

Gabinete

D5.12

Telefone

217903936 (Ext: 795121)

Áreas de Investigação

Credit Ratings

Credit Risk

Scoring and Rating Models

Corporate Finance

Risk Management

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
--------------------------	------	-------	---------

ISCTE-Instituto Universitário de Lisboa	Doutoramento	Finanças	2014
ISCTE-Instituto Universitário de Lisboa	Doutoramento	Finanças	2011
INDEG-IUL	Pós-graduação	Corporate Finance	2001
Universidade Nova de Lisboa Nova School of Business and Economics	Mestrado	Economia Aplicada	1995
Universidade de Lisboa Instituto Superior de Economia e Gestão	Licenciatura	Economia	1989

Atividades Profissionais Externas

Período	Empregador	País	Descrição
2007 - 2010	Equifax	Portugal	
1998 - 2007	Sonaecom	Portugal	Responsável de Controlo de Crédito
1997 - 1998	Banco Mello de Investimentos	Portugal	Gestor de Carteiras de Fundos de Pensões
1994 - 1997	Banco Mello de Investimentos	Portugal	Analista do Risco de Mercado e do Mercado de Rendimento Fixo

Outras Atividades Profissionais

Período	Tipo de Atividade	Descrição da Atividade	Link para mais informação
2022	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: ISCTE Executive Education e Banco de Portugal. 8ª Edição.	--
2022	Coordenação de programas de formação executiva	Análise financeira. Destinatários: quadros do Banco Montepio. Entidade organizadora: ISCTE Executive Education.	--
2022	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: ISCTE Executive Education e Banco de Portugal. 7ª Edição	--
2022	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: ISCTE Executive Education e Banco de Portugal. 7ª Edição.	--
2021	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: ISCTE Executive Education e Banco de Portugal. 6ª Edição.	--

2021	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: ISCTE Executive Education e Banco de Portugal. 6ª Edição	--
2021	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 5ª Edição.	--
2021	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 5ª Edição.	--
2020	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 4ª Edição.	--
2020	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 4ª Edição.	--
2020	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 3ª Edição.	--
2020	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 3ª Edição.	--
2019	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 2ª Edição.	--
2019	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 2ª Edição.	--
2019	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Junior Supervisors and Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 1ª Edição.	--
2019	Coordenação de programas de formação executiva	Market Risk – Experienced Supervisors. Destinatários: quadros do BCE e Bancos Centrais. Entidade organizadora: INDEG e Banco de Portugal. 1ª Edição.	--
2018	Coordenação de programas de formação executiva	Análise e Planeamento Financeiro. Destinatários: quadros da Entidade Reguladora dos Serviços Energéticos (ERSE). Entidade organizadora: INDEG.	--
2017	Coordenação de programas de formação executiva	Credit Risk. Destinatários: quadros da Hiscox Europe. Entidade organizadora: Informa DB.	--

2017	Coordenação de programas de formação executiva	Gestão de Riscos de Mercado. Destinatários: quadros da Caixa Geral de Depósitos. Entidade organizadora: INDEG.	--
2016	Participação em eventos profissionais (com Comunicação)	Orador na Conferência Let's Talk About Risk. Entidade organizadora: Informa DB.	--

Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord
2024/2025	2º	Gestão do Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Economia e Regulação de Instituições Financeiras;	Sim
2024/2025	2º	Modelização Financeira e Plano de Negócios	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Não
2024/2025	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2024/2025	1º	Finanças Empresariais	Curso de Pós Graduação em Gestão de Serviços de Saúde;	Sim
2024/2025	1º	Finanças das Empresas	Mestrado em Economia Monetária e Financeira;	Sim
2024/2025	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2024/2025	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2024/2025	1º	Finanças Empresariais Aplicadas à Gestão de Pessoas	Curso de Pós Graduação em Gestão Estratégica de Pessoas e Liderança;	Sim
2024/2025	1º	Finanças para Executivos	Mestrado em Gestão Aplicada;	Sim
2024/2025	1º	Riscos de Mercado e Taxas de Juro	Outro em Pós-Graduação em Gestão de Riscos;	Não
2024/2025	1º	Risco de Crédito	Outro em Pós-Graduação em Gestão de Riscos;	Não
2024/2025	1º	Risco de Crédito	Outro em Pós-Graduação em Gestão de Riscos;	Não
2024/2025	1º	Risco ESG	Outro em Pós-Graduação em Gestão de Riscos;	Não
2024/2025	1º	Finanças Empresariais	Outro em Programa Aplicado Online em Finanças e Controlo Empresariais;	Sim
2023/2024	2º	Gestão do Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Economia e Regulação de Instituições Financeiras;	Sim
2023/2024	2º	Análise e Planeamento Financeiro	Curso de Pós Graduação em Soluções Analíticas para a Gestão;	Sim

2023/2024	2º	Gestão de Riscos Financeiros	Seminário de Especialização em Gestão de Riscos Financeiros;	Não
2023/2024	2º	Análise Económica e Financeira de Empresas	Outro em Pós Graduação em Gestão para Futuros Líderes;	Não
2023/2024	2º	Análise Financeira de Empresas	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2023/2024	2º	Modelização Financeira e Plano de Negócios	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Não
2023/2024	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	1º	Finanças das Empresas	Mestrado em Economia Monetária e Financeira;	Sim
2023/2024	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2023/2024	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2023/2024	1º	Análise Económica e Financeira de Empresas	Outro em Pós Graduação em Gestão para Futuros Líderes;	Não
2023/2024	1º	Finanças Sustentáveis	Outro em Pós Graduação em Gestão para Lideranças;	Sim
2022/2023	2º	Gestão do Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Economia e Regulação de Instituições Financeiras;	Sim
2022/2023	2º	Análise e Planeamento Financeiro	Curso de Pós Graduação em Soluções Analíticas para a Gestão;	Sim
2022/2023	2º	Análise Financeira de Empresas	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2022/2023	2º	Modelização Financeira e Plano de Negócios	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Não
2022/2023	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	1º	Finanças das Empresas	Mestrado em Economia Monetária e Financeira;	Sim
2022/2023	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2021/2022	2º	Gestão do Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Economia e Regulação de Instituições Financeiras;	Sim
2021/2022	2º	Modelização Financeira e Plano de Negócios	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Não
2021/2022	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim

2021/2022	1º	Finanças das Empresas	Mestrado em Economia Monetária e Financeira;	Sim
2021/2022	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2021/2022	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2020/2021	2º	Gestão do Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Economia e Regulação de Instituições Financeiras;	Sim
2020/2021	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Gestão Industrial e Logística;	Não
2020/2021	2º	Modelização Financeira e Plano de Negócios	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Não
2020/2021	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Finanças das Empresas	Mestrado em Economia Monetária e Financeira;	Sim
2020/2021	1º	Seminário de Projecto em Finanças		Sim
2020/2021	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2020/2021	1º	Estratégia Financeira da Empresa	Mestrado em Gestão;	Não
2019/2020	2º	Gestão do Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Economia e Regulação de Instituições Financeiras;	Sim
2019/2020	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia; Licenciatura em Gestão;	Não
2019/2020	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Finanças das Empresas	Mestrado em Economia Monetária e Financeira;	Sim
2019/2020	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2019/2020	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2019/2020	1º	Fusões, Aquisições e Avaliação de Empresas	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2019/2020	1º	Estratégia Financeira da Empresa	Mestrado em Gestão;	Não
2018/2019	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia;	Não
2018/2019	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2018/2019	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim

2018/2019	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2017/2018	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia;	Não
2017/2018	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2017/2018	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2017/2018	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2016/2017	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia;	Não
2016/2017	2º	Risco de Mercado	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2016/2017	1º	Introdução às Finanças da Empresa		Sim
2016/2017	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2016/2017	1º	Avaliação de Projetos e Empresas	Mestrado em Economia da Empresa e da Concorrência;	Sim
2015/2016	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia; Licenciatura em Gestão;	Não
2015/2016	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia; Licenciatura em Gestão;	Não
2015/2016	2º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Finanças e Contabilidade;	Não
2015/2016	2º	Risco de Mercado	Curso de Pós Graduação em Finanças;	Sim
2015/2016	1º	Introdução às Finanças da Empresa		Sim
2015/2016	1º	Seminário de Projecto em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2015/2016	1º	Gestão Financeira II		Sim
2014/2015	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia;	Não
2014/2015	1º	Gestão Financeira II		Sim
2014/2015	1º	Estratégia Financeira da Empresa	Mestrado em Gestão;	Não
2013/2014	1º	Análise e Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão de Recursos Humanos;	Sim
2013/2014	1º	Gestão Financeira II		Sim

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Pedro Carvalho Neto Gabriel Silva	Initial Margin Estimation and effects	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Afonso Correia Carvalho	Equity Research - Microsoft Corp. (MSFT)	--	Em curso	ISCTE-IUL
2	Guilherme Proença da Cunha Carvalho Portugal	Finanças sustentáveis: investimentos socialmente responsáveis	--	Em curso	ISCTE-IUL
3	Juan Jose Urdaneta Acevedo	Avaliação de Ações: TPI Composites	--	Em curso	ISCTE-IUL
4	Tomás Henriques Soares	Fatores ESG e spread de obrigações corporativas: uma análise quantitativa	--	Em curso	ISCTE-IUL
5	Mayssa Ayadi	O impacto da pandemia nas estratégias de gestão de risco de crédito dos bancos comerciais europeus.	--	Em curso	ISCTE-IUL
6	Afonso Martins Faria Ferreira	Vencer dentro e fora de campo: Um fundo de Private Equity feito à medida para atletas profissionais	--	Em curso	ISCTE-IUL
7	Patrick Miguel Mestre Louzeau	Plano de negócios inovador - Ficusland	--	Em curso	ISCTE-IUL
8	David de Almeida Rita	Plano de Negócios: Mind Balance Psicologia Clínica	--	Em curso	ISCTE-IUL
9	João Tiago Matos Matias	Spreads de dívida bancária: estudo comparativo	--	Em curso	ISCTE-IUL
10	José Pedro Alves Dias	Avaliação do desempenho de hedging de instrumentos financeiros verdes em meio à volatilidade do mercado: uma análise comparativa	--	Em curso	ISCTE-IUL
11	Maria Inês Francisco Baptista Gouveia	Variáveis determinantes da Literacia Financeira em Portugal	--	Em curso	ISCTE-IUL
12	Rodrigo Nuno Matias Constantino	Estratégias Adaptativas: Desempenho de Hedge Funds e Fundos Mútuos no Contexto de Mercados Emergentes	--	Em curso	ISCTE-IUL
13	João Manuel Batalha Calé	Potential Opportunities in the implied volatility of the S&P500	--	Em curso	ISCTE-IUL

14	Inês Filipa Duarte Rafael	Influência da captação das dependências não lineares entre retornos de ativos na medição do risco de mercado	--	Em curso	ISCTE-IUL
15	Tom Alain Michel Dunou	As fusões e aquisições são a melhor estratégia de crescimento na indústria dos media e do entretenimento?	--	Em curso	ISCTE-IUL
16	Adrian Isaias Banda Veloz	Equity Valuation of ADIDAS AG	--	Em curso	ISCTE-IUL
17	Pedro Rodrigues de Areia Brito da Silva	The LBO of Altice	--	Em curso	ISCTE-IUL
18	Fausto Luís Guimarães Barbosa Pé-Leve	State of Art Analysis of the European Carbon Credit Market	--	Em curso	ISCTE-IUL
19	Manuel Maria de Sousa Sapateiro da Silva Rasga	Lending & Credit Fintech: Impacto na Banca Tradicional e nos Consumidores	--	Em curso	ISCTE-IUL
20	Rita Alexandra Carinhas Rosa	Análise do VaR ESG como um fator adicional do modelo Fama-French	--	Em curso	ISCTE-IUL
21	Tomás António Pinto Janeiro	Mercado de Bens de Luxo: Uma Análise Financeira da LVMH	--	Em curso	ISCTE-IUL

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Diogo Filipe Marques Murteira	O Impacto que os Business Angels têm no Desenvolvimento de Start-ups	--	ISCTE-IUL	2024
2	Beatriz Alexandra Barreiros Morais-Pequeno	Os factores que influenciam a Aversão ao Risco	--	ISCTE-IUL	2024
3	Ahmed Abdelfatah Mostafa Khalil Badr	Quão consistentes são as notações de crédito soberano?	--	ISCTE-IUL	2024
4	Maria Carolina Dias Ferreira	Benefícios de Diversificação de um Ativo ligado à Volatilidade	--	ISCTE-IUL	2024
5	João David Sousa Dias	Determinação do risco de crédito: Comparação de ferramentas de machine learning com os modelos tradicionais de IRB	--	ISCTE-IUL	2024
6	Rahman Satyanegara	Análise do Risco e do Desempenho dos Fundos Mútuos Convencionais e Sustentáveis na Europa e na ASEAN	--	ISCTE-IUL	2024

7	Pierre Louis Jean Hervé Guilmineau	Can the trade off theory and the agency cost theory be applied to the case of Hertz's bankruptcy in order to explain the reason(s) for its financial distress and its recovery?	--	ISCTE-IUL	2024
8	Diogo Filipe Maia Gomes	An Assessment of Historical Simulation Techniques for VaR	--	ISCTE-IUL	2024
9	Raquel dos Santos Santiago	Impacto do COVID-19 na rentabilidade financeira dos Laboratórios de Análises Clínicas em Portugal	--	ISCTE-IUL	2024
10	Rui Pinto Caeiro Trancoso Torres	Estratégias de Trading em Obrigações Corporativas através de análise de Valor Relativo	--	ISCTE-IUL	2024
11	Mariana Pinto Cardoso	Lançamento de políticas verdes e o seu impacto na bolsa de valores dos Estados Unidos	Inglês	ISCTE-IUL	2024
12	Maria Saraiva Veiga	Uma alteração no Rating de ESG afeta o Rating de Crédito?	Inglês	ISCTE-IUL	2024
13	Beatriz Tomás de Castro	Modelo Cópula-GARCH condicional para dependências não lineares entre os retornos de ativos	Português	ISCTE-IUL	2023
14	Marta Susana Boino Mota	Paridade Euro-Dólar: o Mercado em 2022 e Impacto nas Empresas	Inglês	ISCTE-IUL	2023
15	João Miguel Garcias Catarino	Backtesting Expected Shortfall: Estudo comparativo e análise de impacto nos requisitos de capital	Inglês	ISCTE-IUL	2023
16	Colin Michel Armand Barbot	Comparação do desempenho de uma carteira de ações de Investimento Socialmente Responsável e índices convencionais para investidores privados franceses.	Inglês	ISCTE-IUL	2023
17	Rui Pedro Amado Costa	Equity Research: Greenvolt - Energias Renováveis, S.A.	Inglês	ISCTE-IUL	2023
18	Mariana Sofia Oliveira Moita	Drivers do crescimento das PMEs em Portugal	Português	ISCAL	2022
19	Pedro Dinis Cabrita Campina	Impacto dos compromissos de transição climática no desempenho financeiro numa indústria de altas emissões carbónica	Inglês	ISCTE-IUL	2022
20	João Manuel dos Santos Patrício	Estabilidade dos ratings - Sensibilidade das agências de rating ao ciclo económico	Inglês	ISCTE-IUL	2022
21	Gagan Chhabra	Differences and similarities between Traditional Day Trading and Cryptocurrency Day Trading	Inglês	ISCTE-IUL	2022

22	Beatriz Ferreira Jacinto	Acesso ao crédito por parte dos jovens adultos: O caso português	Português	ISCTE-IUL	2022
23	João Filipe Gouveia	Risco vs Retorno: Análise Comparativa entre um Mercado Desenvolvido e um Mercado Emergente	Inglês	ISCTE-IUL	2022
24	Ricardo Daniel Moreira dos Santos	Modelo de Previsão do Risco de Crédito das Sociedades Desportivas do Futebol Profissional Português	Inglês	ISCTE-IUL	2022
25	Pedro Gonçalo Ferreira de Sá	As sociedades portuguesas com a designação comercial de sociedade anónimas manipulam a informação financeira?	Português	ISCAL	2021
26	Daniela Sofia dos Santos Alberto	Padrões do risco assimétrico	Inglês	ISCTE-IUL	2021
27	Beatriz Simões Marcolino	Métodos de avaliação completa para medir o risco de mercado: comparação das perspetivas forward looking vs backward looking	Português	ISCTE-IUL	2021
28	João Pedro Lira Gomes de Almeida Belo	Perspectiva do mercado sobre as novas tecnologias: O caso da Tesla	Inglês	ISCTE-IUL	2021
29	Simon Müller	Finanças Corporativas no novo ecossistema da era digital - Influência da tecnologia blockchain na contabilidade forense	Inglês	ISCTE-IUL	2021
30	Zhou Wenyi	Fintech vs. Serviços financeiros tradicionais: como os investidores estão reagindo?	Inglês	ISCTE-IUL	2021
31	Alexandre Miguel de António Serrano	Prémio de Risco de Volatilidade: Novos conhecimentos sobre a vantagem sistemática dos vendedores de opções financeiras.	Inglês	ISCTE-IUL	2021
32	André Acácio Silva Monteiro	Impacto da China na Economia Mundial	Inglês	ISCTE-IUL	2020
33	Bernardo Rui Vaz Silva	Previsão e distinção de falência: Aplicação de um Modelo de Mercado e de um Híbrido a empresas publicamente cotadas nos EUA de 2008 a 2018	Inglês	ISCTE-IUL	2020
34	Marta Sofia Balseiro Rodrigues	Revisão Fundamental da Carteira de Negociação - Avaliação do Impacto nos Requisitos de Capital dos Bancos	Inglês	ISCTE-IUL	2020
35	Miguel Oliveira dos Reis Barroso	Testes de Stress Inversos: Identificar fraquezas para prevenir falências	Inglês	ISCTE-IUL	2020
36	Tomás Eva Ferreira Castelo Lopes	Crédito concedido nos países da União Europeia antes de 2007/08 vs pós 2007/08	Português	ISCTE-IUL	2020

37	Ana Isabel Rolo de Paiva	Bases Fundamentais da Sobrevivência Empresarial: Evidência das novas empresas criadas em Portugal	Português	ISCTE-IUL	2020
38	Ana Catarina Pereira do Rosário	A Poupança em Portugal. Uma política de taxas de juro baixas e o incentivo a poupança.	Português	ISCTE-IUL	2020
39	Ana Francisca Figueira Conceição	Procura da Atividade Seguradora em Portugal Grécia e Itália	Português	ISCAL	2019
40	Joana Sofia da Silva Ferreira	O impacto esperado da segunda Diretiva dos Serviços de Pagamento em Portugal, a três níveis: Consumidores, Bancos Tradicionais e Fintechs	Inglês	ISCTE-IUL	2019
41	Miguel Ângelo Gonçalves Amado	O Efeito da Classificação do Crédito Soberano sobre o Preço dos Bancos em toda a Zona Euro	Inglês	ISCTE-IUL	2019
42	Tan Aiming	Estratégias de negociação no mercado de acionista chinês	Inglês	ISCTE-IUL	2019
43	Raquel Gil Azenha	O Risco de Liquidez Bancária	Português	ISCAL	2018
44	Xuelin Wu	Análise de Investimento em Estoque de conceito "Médica + Internet "	Inglês	ISCTE-IUL	2018
45	Pedro Miguel dos Santos Silva	Determinantes das Falhas dos Bancos Europeus nos Testes de Stress	Inglês	ISCTE-IUL	2018
46	Rodrigo dos Santos Primor	A Influência Macroeconómica no Risco de Crédito	Português	ISCTE-IUL	2018
47	Maria Beatriz Canelas de Oliveira	Determinantes da Recuperação do Crédito Vencido em Portugal: O caso das sociedades não financeiras	Português	ISCTE-IUL	2017
48	Pedro Filipe da Costa Gancho Veríssimo	The unfolding of South European banks risk: A cross-time comparison with Western European banks at the Banking Union level	Inglês	ISCTE-IUL	2017
49	Peiyi Xu	The Impact of the European Central Bank Monetary Policy on Government Bonds After the Financial Crisis of 2008	Inglês	ISCTE-IUL	2017
50	Inês Nunes Pedras	The Impact of Credit Rating Agencies Downgrades on European Stock Markets During the Financial Crisis of 2008	Inglês	ISCTE-IUL	2016
51	Tânia Sofia Miranda Martins Marçal	The impact of the Non-Performing Loans on Banks' Lending	Inglês	ISCTE-IUL	2016
52	Ivo Miguel de Andrade Álvares Furtado	Financing conditions and sustainability of SMEs in Portugal	Inglês	ISCTE-IUL	2015

53	Hugo André Ferreira de Freitas	The Impact of Bank Regulatory Capital on Liquidity Creation - A critical issue for euro area policy makers	Inglês	ISCTE-IUL	2014
54	Hernâni Alexandre Morais de Oliveira	A Reputação das Empresas e o Desempenho Bolsista	Português	ISCTE-IUL	2014
55	Ricardo Jorge Santos Alves	Information Value of Eu-Wide Stress Tests: How did the market react to stress test results?	Inglês	ISCTE-IUL	2013
56	Marina Isabel Vicente Marques	Idiosincrasias Sectoriais no Risco de Crédito	Português	ISCTE-IUL	2012
57	Vítor Manuel Morais Pereira	Seleção Adversa na Concessão de Crédito a Particulares em Portugal.	Português	ISCTE-IUL	2009

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	João Miguel Belchior Delfino	Equity Research: Sport Lisboa e Benfica - Futebol, SAD	Português	ISCAL	2024
2	Joana Costa Aleixo	Plano de Negócios Inovador: Inteligência Artificial no Setor da Gestão de Condomínios	--	ISCTE-IUL	2024
3	Maria Manuel Afonso Ribeiro	O Potencial dos Unicórnios: o caso da Feedzai	Inglês	ISCTE-IUL	2023
4	Mafalda Pereira Mendes Baptista da Costa	Plano de negócios inovador - CONCEITO BEM-ESTAR	Português	ISCTE-IUL	2021
5	Cláudia Filipa Ferreira Clara Mota da Silva	Parkaki - O teu lugar de estacionamento em Lisboa	Português	ISCTE-IUL	2021
6	Yao Jiayu	ANALYSIS OF THE FINTECH INDUSTRY: FROM LENDING CLUB	Inglês	ISCTE-IUL	2019
7	Ana Catarina Silva José	Qual o Efeito da Crise no Crédito Automóvel?	Português	ISCAL	2018
8	Catarina Isabel dos Santos Cuiça	Impacto da Crise Financeira no Negócio do Crédito Bancário e Sociedades de Garantia Mútua	Português	ISCAL	2018
9	Ana Rita Teixeira Borges Sabino	The Impact of the Basel Accords in Lending Activity: The case of Portugal and Germany	Inglês	ISCAL	2017
10	Sónia Isabel da Silva Miguel	O Risco de Incumprimento nos Fundos de Investimento Imobiliário de Arrendamento Habitacional: Estudo de caso	Português	ISCAL	2017
11	Rita Isabel André Baptista Pereira	Modelos de Avaliação do Risco de Crédito nas Instituições CGD, BCP, e Santander Totta	Português	ISCAL	2017

12	Inês Cristina Borreicho Prates	Equity Valuation: The Navigator Company	Inglês	ISCTE-IUL	2017
13	Nelson Guerreiro Martins Casquilho	Implementação de um Balanced Scorecard na Turexpresso	Português	ISCTE-IUL	2017
14	Telma Simões Rodrigues	Caso de Estudo: BES	Português	ISCAL	2016
15	Sara de Vilarigues Baião Alves	Análise do Risco de Crédito de Empresas: Aplicação ao caso da Ydreams	Português	ISCAL	2016
16	Jingwen Liu	Potential Determinants of RMB Exchange Rate	Inglês	ISCTE-IUL	2016
17	Ana Cristina Guerreiro Silva	O Perfil de Risco das PME com Garantias Autónomas	Português	ISCTE-IUL	2013
18	Telma Carina Santos Cabral	Credit Spreads Determinants in Portugal. Na empirical analysis of the main drivers of spreads to non-financial organizations	Inglês	ISCTE-IUL	2013
19	Margarida de Lagos Vian Correia de Almeida	M&A: The case of Optimus and Zon	Inglês	ISCTE-IUL	2013

Total de Citações

Web of Science®	71
Scopus	80

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Carvalho, Paulo V., Pinheiro, C. & Rodrigues, M. S. (2024). The impact of the Fundamental Review of the Trading Book: Evaluation on a stylized portfolio. <i>Journal of Risk</i> . 26 (3), 49-73 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1
2	Vieira, D. S., Carvalho, P. V., Curto, J. & Laureano, L. (2023). Gold's hedging and safe haven properties for European stock and bond markets. <i>Resources Policy</i> . 85 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 8
3	Carvalho, P. V., Ferrão, J., Alves, J. & Sarmiento, M. (2023). The informational value contained in the different types of auditor's opinions: Evidence from Portugal. <i>Cogent Economics and Finance</i> . 11 (1) - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 3

4	Carvalho, P. V., Shah, S. S. H., Zaheer, A., Mata, M. N. & Lourenço, A. M. (2022). The effect of inventory leanness on firms' credit ratings: The case of Pakistan. <i>Risks</i> . 10 (12) - N.º de citações Google Scholar: 3
5	Carvalho, P. V., Curto, J. D. & Primor, R. (2022). Macroeconomic determinants of credit risk: evidence from the Eurozone. <i>International Journal of Finance and Economics</i> . 27 (2), 2054-2072 - N.º de citações Web of Science®: 11 - N.º de citações Scopus: 8 - N.º de citações Google Scholar: 22
6	Tomiwa Sunday Adebayo, Manuel Francisco Coelho, Dilber Çalar Onbaolu, Husam Rjoub, Mata, Mário Nuno, Carvalho, Paulo V....Ibrahim Adeshola (2021). Modeling the Dynamic Linkage between Renewable Energy Consumption, Globalization, and Environmental Degradation in South Korea: Does Technological Innovation Matter?. <i>Energies</i> . 14 (14), 4265 - N.º de citações Web of Science®: 57 - N.º de citações Scopus: 62 - N.º de citações Google Scholar: 75
7	Veríssimo, P., Carvalho, P. V. & Laureano, L. (2021). Asymmetries in the Euro area banking profitability. <i>The Journal of Economic Asymmetries</i> . 24 - N.º de citações Scopus: 2 - N.º de citações Google Scholar: 6

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

1	Carvalho, Paulo V. (2009). <i>Fundamentos da Gestão de Crédito - Uma contribuição para o valor das organizações</i> . Lisboa. Sílabo.
---	---

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Publicação em atas de evento científico

1	Alves, J. S., Sarmento, M. & Carvalho, P. V. de. (2017). Eficácia do relatório de auditoria sobre o pressuposto da continuidade. In <i>OCC - Ordem dos Contabilistas Certificados (Ed.), XVI Congresso Internacional de Contabilidade e Auditoria: Da academia à profissão</i> . Aveiro: OCC - Ordem dos Contabilistas Certificados. - N.º de citações Google Scholar: 6
---	---

- Comunicação em evento científico

1	Rosário, J., Carvalho, Paulo V. & Boutin, Landry (2021). Current Relation between Ecological Footprint and Country Risk Premium. 7th International Conference on CSR, Sustainability, Ethics and Governance.
2	Veríssimo, P., Carvalho, P. & Laureano, L. (2018). The unfolding of Euro Area banks' profitability. 10th Portuguese Finance Network Conference.
3	Carvalho, P., Laux, P. & Pereira, J. (2014). Assessing the stability of credit ratings. IFABS 2014 Conference.
4	Carvalho, P., Laux, P. & Pereira, J. (2014). Is There a Self-fulfilling Prophecy in Credit Rating Announcements?. 2014 FMA European Conference. - N.º de citações Google Scholar: 2

5	Carvalho, P., Laux, P. & Pereira, J. (2014). Is There a Self-fulfilling Prophecy in Credit Rating Announcements?. EFMA 2014 Annual Meetings.
6	Carvalho, P., Laux, P. & Pereira, J. (2014). Is There a Self-fulfilling Prophecy in Credit Rating Announcements?. 2014 FMA Annual Meeting. - N.º de citações Google Scholar: 2
7	Carvalho, P., Laux, P. & Pereira, J. (2014). Is There a Self-fulfilling Prophecy in Credit Rating Announcements?. 8th Portuguese Finance Network. - N.º de citações Google Scholar: 2

• Outras Publicações

- Artigo sem avaliação científica

1	Carvalho, P., Laux, P. & Pereira, J. (2014). The stability and accuracy of credit ratings. SSRN. - N.º de citações Google Scholar: 13
---	--

- Tese de Doutoramento

1	Carvalho, Paulo V. (2014). Essays on credit rating announcements.
---	---

Produtos			
Tipo de Produto	Título do Produto	Descrição Detalhada	Ano
Protótipo	Soluções de Análises Preditivas	Desenvolvimento de modelos de previsão da insolvência	2022
Protótipo	Score ESG	Desenvolvimento de solução analítica para classificar as empresas em termos das componentes ambientais, sociais e de governance (ESG)	2022
Protótipo	Indicador de Resiliência Financeira	Desenvolvimento de indicador para medir a resiliência financeiras das empresas e avaliar a capacidade de cada uma enfrentar choques económicos.	2020
Protótipo	Soluções de Análises Preditivas	Desenvolvimento de modelos de previsão do incumprimento de pagamentos	2017
Protótipo	Soluções de Análises Preditivas	Desenvolvimento de modelos de previsão da insolvência	2015
Protótipo	Desenvolvimento de modelos analíticos	Desenvolvimento de modelos de previsão da viabilidade de negócio	2014

Protótipo	Soluções de Análises Preditivas	Desenvolvimento de modelos de previsão do incumprimento de pagamentos	2013
-----------	---------------------------------	---	------