Aviso: [2026-09-25 13:42] 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.

Pedro Maria Corte Real Alarcão Judice

Investigador Integrado
BRU-Iscte - Business Research Unit

Contactos

E-mail	Pedro.Judice@iscte-iul.pt
Telefone	217903936 (Ext: 795121)

Currículo

(Biography as at 22 Aug 2026) Pedro Júdice is a director at Montepio Bank in Lisbon, and a researcher at ISCTE Business Research Unit. He started his banking career in 2003 as a quantitative research associate at JPMorgan Chase in London, and in 2006 he joined Montepio Bank as a director. Since then, he had several different roles at this bank, in market risk, non-core asset sales, strategic planning, asset-liability management, financial sector research, and ESG Risk. Pedro has a Ph.D. from the Courant Institute of Mathematical Sciences (New York University, 2003) and was a postdoctoral research associate at the University of Chicago Booth School of Business (2011-2012). He was an invited assistant professor at ISCTE Business School in Lisbon (2010-2012), a Visiting Professor (Feb 2022-Apr 2022) and Associate Graduate Faculty (2022-2025) at Western Michigan University, and served as a regional co-director for the Global Association of Risk Professionals (2008-2012). His academic research has focused on practical banking problems, and he has published in the Journal of Banking and Finance and Expert Systems with Applications, among other journals.

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
Universidade de Chicago	Pós-Doutoramento	Operations Management	2012
New York University	Doutoramento	Matemática	2003
Universidade de Coimbra Departamento de Matematica	Licenciatura	Matemática	1998

Atividades Profissionais Externas

Período	Empregador	País	Descrição
Desde 2006	Montepio Geral	Portugal	

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Sagara Dewasurendra	The optimum leverage level of the banking sector	Inglês	Western Michigan University	2019

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Sofia Costa	Cross-sectional modelling of bank deposits	Inglês	Universidade Nova de Lisboa	2019
2	Catarina Coelho	Modelo Robusto de Gestão de Balanço para Bancos	Português	Universidade de Coimbra	2018

Total de Citações

Web of Science®	53
Scopus	56

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Dewasurendra, S., Júdice, P. & Zhu, Q. J. (2026). Risk-adjusted Kelly investing under non-homogeneous reward and risk. Risks, 14(9). https://doi.org/10.3390/risks14090216

2	Coelho, C., Santos, J. L. & Judice, P. (2024). The performance of bank portfolio optimization. International Transactions of Operations Research, 31(3), 1458?1485. https://doi.org/10.1111/itor.13395 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 3
3	Brito, R. P. & Judice, P. (2023). Efficient credit portfolios under IFRS 9. International Transactions of Operations Research, 30(5), 2453?2484. https://doi.org/10.1111/itor.13137 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 5
4	Brito, R. P. & Judice, P. (2022). Asset classification under the IFRS 9 framework for the construction of a banking investment portfolio. International Transactions of Operations Research, 29(4), 2618?2648. https://doi.org/10.1111/itor.12976 - N.º de citações Web of Science®: 10 - N.º de citações Scopus: 6
5	Judice, P., Pinto, L. & Santos, J. L. (2021). Bank strategic asset allocation under a unified risk measure. Expert Systems with Applications, 185. https://doi.org/10.1016/j.eswa.2021.115574 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 5
6	Judice, P. & Zhu, Q. J. (2021). Bank balance sheet risk allocation. Journal of Banking and Finance, 133. https://doi.org/10.1016/j.jbankfin.2021.106257 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 4
7	Costa, S., Faias, M., Judice, P. & Mota, P. (2021). Panel data modeling of bank deposits. Annals of Finance, 17, 247?264. https://doi.org/10.1007/s10436-020-00373-1 - N.º de citações Scopus: 3
8	Dewasurendra, S., Judice, P. & Zhu, Q. (2019). The optimum leverage level of the banking sector. Risks, 7(2), 1?29. https://doi.org/10.3390/risks7020051 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 9
9	Birge, J. R. & Judice, P. (2013). Long-term bank balance sheet management: estimation and simulation of risk-factors. Journal of Banking and Finance, 37(12), 4711?4720. https://doi.org/10.1016/j.jbankfin.2013.07.040 - N.º de citações Web of Science®: 26 - N.º de citações Scopus: 20

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

1	Judice, P., S. Maier-Paape, A. Platen & Q.J. Zhu (2023). Scalar and Vector Risk Measures in the General Framework of Portfolio Theory. Springer Science and Business Media LLC. https://doi.org/10.1007/978-3-031-33321-7

- Capítulo de livro

1	Judice, P. (2023). Bank balance sheet optimization. Reference Module in Social Sciences. Elsevier. https://doi.org/10.1016/B978-0-44-313776-1.00023-4 - N.º de citações Scopus: 1

Prémios

Research scholarship, Fundação Luso-Americana para o Desenvolvimento (2012)

Postdoctoral Scholarship, Fundação para a Ciência e Tecnologia (2012)

Fulbright Visiting Scholar at the University of Chicago (2012)

Bolsa de investigação, New York University (2002)

Bolsa de Doutoramento, Fundação para a Ciência e Tecnologia, 1998-2002. (1998)

Prémio Doutor João Farinha para o melhor aluno do curso de Matemática, 1998, Universidade de Coimbra (1998)