

Aviso: [2024-07-03 07:22] 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.

Pedro Maria Corte Real Alarcão Judice

Investigador Integrado

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

Contactos

E-mail

Pedro.Judice@iscte-iul.pt

Telefone

21 7903936 (Ext: 795121)

Currículo

Pedro Júdice is a director at Montepio Bank in Lisbon, associate graduate faculty at Western Michigan University, and an integrated 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, and financial sector research. 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 at Western Michigan University (Feb 2022-Apr 2022), 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® | 37 |
| Scopus | 35 |

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

| | |
|---|--|
| 1 | Coelho, C., Santos, J. L. & Judice, P. (2024). The performance of bank portfolio optimization. International Transactions of Operations Research. 31 (3), 1458-1485 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 |
|---|--|

| | |
|---|---|
| 2 | <p>Brito, R. P. & Judice, P. (2023). Efficient credit portfolios under IFRS 9. <i>International Transactions of Operations Research</i>. 30 (5), 2453-2484</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 3</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p> |
| 3 | <p>Brito, R. P. & Judice, P. (2022). Asset classification under the IFRS 9 framework for the construction of a banking investment portfolio. <i>International Transactions of Operations Research</i>. 29 (4), 2618-2648</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 6</p> <p>- N.º de citações Scopus: 3</p> |
| 4 | <p>Judice, P. & Zhu, Q. J. (2021). Bank balance sheet risk allocation. <i>Journal of Banking and Finance</i>. 133</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 2</p> <p>- N.º de citações Scopus: 3</p> |
| 5 | <p>Costa, S., Faias, M., Judice, P. & Mota, P. (2021). Panel data modeling of bank deposits. <i>Annals of Finance</i>. 17, 247-264</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p> |
| 6 | <p>Judice, P., Pinto, L. & Santos, J. L. (2021). Bank strategic asset allocation under a unified risk measure. <i>Expert Systems with Applications</i>. 185</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p> |
| 7 | <p>Dewasurendra, S., Judice, P. & Zhu, Q. (2019). The optimum leverage level of the banking sector. <i>Risks</i>. 7 (2), 1-29</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 4</p> <p>- N.º de citações Scopus: 7</p> |
| 8 | <p>Birge, J. R. & Judice, P. (2013). Long-term bank balance sheet management: estimation and simulation of risk-factors. <i>Journal of Banking and Finance</i>. 37 (12), 4711-4720</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 19</p> <p>- N.º de citações Scopus: 17</p> |

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

| | |
|---|---|
| 1 | <p>Judice, P., S. Maier-Paape, A. Platen & Q.J. Zhu (2023). <i>Scalar and Vector Risk Measures in the General Framework of Portfolio Theory</i>. Springer Science and Business Media LLC.</p> |
|---|---|

- Capítulo de livro

| | |
|---|--|
| 1 | <p>Judice, P. (2023). Bank balance sheet optimization. In <i>Reference Module in Social Sciences</i>.: Elsevier.</p> |
|---|--|

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)