

**Aviso:** [2024-10-15 10:15] 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®	39
Scopus	36

## 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. &amp; 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. &amp; 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>Costa, S., Faias, M., Judice, P. &amp; 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>
5	<p>Judice, P., Pinto, L. &amp; 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>
6	<p>Judice, P. &amp; 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>
7	<p>Dewasurendra, S., Judice, P. &amp; 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®: 6</p> <p>- N.º de citações Scopus: 8</p>
8	<p>Birge, J. R. &amp; 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 &amp; 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)

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

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