Aviso: [2026-11-13 15:36] 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.

Szabolcs Sebestyén

Professor Auxiliar
Departamento de Finanças (IBS)

Contactos

E-mail	Szabolcs.Sebestyen@iscte-iul.pt
Gabinete	D5.21
Telefone	217650525 (Ext: 221247)
Cacifo	208

Áreas de Investigação

Financial economics, financial econometrics, asset pricing, monetary policy, financial markets, credit risk, high-frequency finance, Bayesian econometrics

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
University of Alicante	Doutoramento	PhD in Economics	2006

Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord.
2026/2027	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2026/2027	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2026/2027	1º	Trabalho de Projecto em Finanças		Sim
2026/2027	1º	Dissertação em Finanças		Sim
2026/2027	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2026/2027	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim
2025/2026	2º	Gestão Financeira Internacional		Não
2025/2026	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2025/2026	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2025/2026	1º	Trabalho de Projecto em Finanças		Sim
2025/2026	1º	Dissertação em Finanças		Sim
2025/2026	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2025/2026	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim
2024/2025	2º	Gestão Financeira Internacional		Não
2024/2025	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2024/2025	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2024/2025	1º	Dissertação em Finanças		Sim
2024/2025	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2024/2025	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2023/2024	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2023/2024	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2023/2024	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não

2022/2023	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2022/2023	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	1º	Investimentos		Sim
2021/2022	2º	Gestão Financeira Internacional		Não
2021/2022	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2021/2022	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2021/2022	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2020/2021	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2020/2021	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim
2019/2020	2º	Investimentos	Licenciatura em Gestão;	Não
2019/2020	2º	Finanças Internacionais	Curso Institucional em Escola de Gestão;	Sim
2019/2020	2º	Finanças para Negócios Internacionais	Mestrado em Gestão Internacional;	Sim
2019/2020	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2019/2020	1º	Finanças de Empresa	Licenciatura em Gestão;	Não
2019/2020	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Sim

Orientações

• Teses de Doutoramento

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Ana Catarina Vilela Lopes Ferreira	"How does capital requirements composition affect banks´ performance, risk and financial system stability".	Inglês	Entregue	Iscte

2	William Opoku	Essays on exploring the interplay between firm size, management models, fees, and performance in mutual funds: a study on investor behavior and cost justification	Inglês	Entregue	Iscte

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Aguinaldo Sanches Barradas	Estratégia de Hedge Dinâmica para Títulos Soberanos U.S. Treasuries	--	Em curso	Iscte
2	Rea Ashrafi	Análise da Avaliação de Empresa e Desenvolvimento Futuro da NVIDIA	Inglês	Em curso	Iscte
3	Magly Xavier Trentini	Uma Avaliação Econométrica do Impacto do Collapso do Silicon Valley Bank na Dinâmica e Volatilidade da SOFR	Inglês	Em curso	Iscte
4	Guilherme Santos Costa	Valor em risco: Uma ferramenta estratégica para a otimização de carteiras de investimentos e a gestão de riscos	Inglês	Em curso	Iscte
5	Diogo Rocha Ávila	Análise Empírica da Estrutura Temporal das Taxas de Juro e o Seu Efeito na Yield Curve em Portugal	--	Em curso	Iscte

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Mathilde Barbarisque	Resiliência de Carteiras Passivas Multiativos Construídas pelo Próprio Investidor em Períodos de Tensão Financeira: Evidência da Crise da COVID-19	Inglês	Iscte	2026
2	Ghalia Nokry	O Impacto das Criptomoedas nas Estratégias de Diversificação	Inglês	Iscte	2026
3	Kaviesen Kathir	Factores económicos que influenciam a rentabilidade do investimento na produção terrestre de salmão na China e em Portugal.	Inglês	Iscte	2025
4	Diogo José Lima Ramos	Modelo de Lotka-Volterra Estocástico para Dinâmicas Financeiras	Inglês	Iscte	2025

5	Erwan Peron	Volatilidade do mercado de ações setorial durante a pandemia da COVID-19: uma análise GARCH de dados agregados sobre ações francesas e portuguesas	Inglês	Iscte	2025
6	Margaux Lahitette	Dinâmica da taxa de câmbio e desempenho setorial: Explorando a transmissão internacional no mercado financeiro francês	Inglês	Iscte	2025
7	Afonso Chaves Gomes Romano Pires	Estratégias Hibridas de Gestão de Portfólios de Investimento	Inglês	Iscte	2024
8	André Filipe Assunção Damásio	Prémio de risco para futuros do VIX-squared sob o modelo de Eraker-Wu (2017)	Inglês	Iscte	2023
9	Francisca Moreno Damas	Obrigações Verdes: Explorar o Greenium Corporativo	Inglês	Iscte	2021
10	Manuel João Pedro Amaro	Ajustamento de Capital nos Bancos Portugueses	Inglês	Iscte	2020
11	Oxana Nikolaevna Lykova Alves	A influência das sanções no comércio externo da Rússia	Inglês	Iscte	2020
12	Tomas Hlavaty	Portfolio Optimization Methods, Their Application and Evaluation	Inglês	Iscte	2018
13	João Guilherme de Almeida	Impact of European monetary policy on bank equity prices	Inglês	Iscte	2017
14	Yihao Chen	The Sensitivity Analysis of Views Related Parameters in the Black-Litterman Model	Inglês	Iscte	2017
15	Ana Sílvia Boutte Fagulha Baguecho	The Impact of Capital Controls on Firm Value	Inglês	Iscte	2016
16	Ricardo Miguel Furtado Lisboa	Religion and Modern Finance: Islamic Banking and the use of Derivatives	Inglês	Iscte	2016
17	José Pedro Meira Campino	The Impact of ECB'S Monetary Policy on Euro´s Exchange Rate	Inglês	Iscte	2015
18	Marta Rotaru	Heterogeneity of Lending Rates in the Euro Area and ECB'S Non Standard Measures	Inglês	Iscte	2013

• Projetos Finais de Mestrado

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Ana Maria Caria da Silva	The Determinants of the Portuguese Sovereign Debt Spread	Inglês	Iscte	2015

2	André Alexandre Gil Penha	The Effect of Credit Rating Agencies in Stock Prices Event Study in Germany and Portugal	Inglês	Iscte	2015
3	João Paulo Belo Branco	How can Rating Agencies Influence the Stock Markets	Inglês	Iscte	2012

Total de Citações

Web of Science®	86
Scopus	62

Publicações

- **Revistas Científicas**

- Artigo em revista científica

1	León, Á. & Sebestyén, Sz. (2012). New measures of monetary policy surprises and jumps in interest rates. Journal of Banking and Finance, 36(8), 2323?2343. https://doi.org/10.1016/j.jbankfin.2012.04.014 - N.º de citações Web of Science®: 23 - N.º de citações Scopus: 18
2	Andersson, M., Overby, L. J. & Sebestyén, S. (2010). Which news moves the euro area bond market?. German Economic Review, 10(1), 1?31. https://doi.org/10.1111/j.1468-0475.2008.00439.x - N.º de citações Web of Science®: 63 - N.º de citações Scopus: 44

Cargos de Gestão Académica

Director (2026 - 2029)
Unidade/Área: Mestrado em Finanças

Membro (2026 - 2030)
Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2024 - 2026)
Unidade/Área: Mestrado em Finanças

Prémios

Melhor estudo de rendimento fixo no XVI Finance Forum, Barcelona (2008)