

Aviso: [2024-12-22 01:50] 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.

Szabolcs Sebestyén

Professor Auxiliar

Departamento de Finanças (IBS)

Investigador Associado sem Financiamento FCT

BRU-Iscte - Business Research Unit (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
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	Seminário de Especialização em Gestão Financeira Internacional;	Sim
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	Em curso	ISCTE-IUL

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Margaux Lahitette	Dinâmica da taxa de câmbio e desempenho setorial: Explorando a transmissão internacional no mercado financeiro francês	--	Em curso	ISCTE-IUL
2	Kaviesen Kathir	Factores económicos que influenciam a rentabilidade do investimento na produção terrestre de salmão na China e em Portugal: um estudo comparativo.	--	Em curso	ISCTE-IUL
3	Diogo Rocha Ávila	Análise Empírica da Estrutura Temporal das Taxas de Juro e o Seu Efeito na Yield Curve em Portugal	--	Em curso	ISCTE-IUL
4	Pedro Nuno Jacinto Costa Galriça	The Impact of the Eurosystem's Corporate Security Purchase Programme on the European Green Bond Market	--	Em curso	ISCTE-IUL

5	Erwan Peron	Aplicação de modelos GARCH para estimar as reacções dos mercados bolsistas durante as diferentes fases da pandemia de COVID-19: Casos de França e Portugal	--	Em curso	ISCTE-IUL
---	-------------	--	----	----------	-----------

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Afonso Chaves Gomes Romano Pires	Estratégias Híbridas de Gestão de Portfólios de Investimento	--	ISCTE-IUL	2024
2	André Filipe Assunção Damásio	Prémio de risco para futuros do VIX-squared sob o modelo de Eraker-Wu (2017)	Inglês	ISCTE-IUL	2023
3	Francisca Moreno Damas	Obrigações Verdes: Explorar o Greenium Corporativo	Inglês	ISCTE-IUL	2021
4	Manuel João Pedro Amaro	Ajustamento de Capital nos Bancos Portugueses	Inglês	ISCTE-IUL	2020
5	Oxana Nikolaevna Lykova Alves	A influência das sanções no comércio externo da Rússia	Inglês	ISCTE-IUL	2020
6	Tomas Hlavaty	Portfolio Optimization Methods, Their Application and Evaluation	Inglês	ISCTE-IUL	2018
7	João Guilherme de Almeida	Impact of European monetary policy on bank equity prices	Inglês	ISCTE-IUL	2017
8	Yihao Chen	The Sensitivity Analysis of Views Related Parameters in the Black-Litterman Model	Inglês	ISCTE-IUL	2017
9	Ana Sílvia Boutte Fagulha Baguecho	The Impact of Capital Controls on Firm Value	Inglês	ISCTE-IUL	2016
10	Ricardo Miguel Furtado Lisboa	Religion and Modern Finance: Islamic Banking and the use of Derivatives	Inglês	ISCTE-IUL	2016
11	José Pedro Meira Campino	The Impact of ECB'S Monetary Policy on Euro 's Exchange Rate	Inglês	ISCTE-IUL	2015
12	Marta Rotaru	Heterogeneity of Lending Rates in the Euro Area and ECB'S Non Standard Measures	Inglês	ISCTE-IUL	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-IUL	2015

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

Total de Citações

Web of Science®	69
Scopus	61

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	León, Á. & Sebestyén, Sz. (2012). New measures of monetary policy surprises and jumps in interest rates. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 36 (8), 2323-2343 - N.º de citações Web of Science®: 20 - N.º de citações Scopus: 18
2	Andersson, M., Overby, L. J. & Sebestyén, S. (2010). Which news moves the euro area bond market?. <i>German Economic Review</i> . 10 (1), 1-31 - N.º de citações Web of Science®: 49 - N.º de citações Scopus: 43

Cargos de Gestão Académica

Director (2023 - 2026)
Unidade/Área: Mestrado em Finanças

Prémios

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