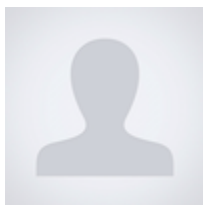


Luís Alberto Ferreira de Oliveira

Perfil



Departamento Departamento de Finanças

E-mail luis.oliveira@iscte-iul.pt

Webpage <http://iscte.pt/~lafo>

Categoria Professor Auxiliar

Gabinete D5.25

Cacifo 045AA

Telefone 217650521

Currículo DeGóis [Consultar o currículo DeGóis](#)

Escola no portal Ciência-IUL [Consultar o perfil Ciência-IUL](#)

Interesses de Ensino e Investigação

- Mercados Financeiros, Gestão de Risco de Mercado, Gestão de Risco Taxa de Juro, Derivados Financeiros

Qualificações

Tipo	Programa	Instituição	Ano
Doutoramento	Gestão	ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	2007
Mestrado	Finanças	ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	2002
Licenciatura	Economia	Instituto Superior de Economia e Gestão - UTL	1990

Atividades Académicas

Unidades curriculares

[Finanças de Empresa](#) (Coordenador)

[Finanças de Empresa](#) (Coordenador)

[Finanças de Empresa](#) (Coordenador)

[Finanças de Empresa](#) (Coordenador)

[Finanças de Empresa](#) (Coordenador)

[Gestão de Activos Financeiros](#) (Coordenador)

Gestão de Activos Financeiros (Coordenador)

Gestão de Activos Financeiros (Coordenador)

Gestão de Activos Financeiros (Coordenador)

Gestão de Activos Financeiros (Coordenador)

Gestão de Activos Financeiros (Coordenador)

Investimentos

Investimentos

Investimentos

Orientações

Dissertação de Mestrado

Maria Isabel Pessoa Jorge de Oudinot Larcher, "Determinantes dos Spreads de Crédito Soberanos nos Países Periféricos da Zona Euro ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2017

Luis Miguel Gonçalves Oliveira Palma Carlos, "Predicting Successful per Reorganizations - Testing the applicability of Altman Z-Score on Portuguese Companies", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2017

José Pedro Figueiredo de Magalhães, "Countercyclical Capital Buffer ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2017

Safiya Ahmad, "The impact of Hedging on a Portuguese Non-Financial Firm ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2017

Marta Sofia Pepe Ferreira, "Decomposição da Cross-Sectional Volatility no Mercado de Ações Português ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2016

Tomás Coutinho Grosso de Oliveira Salen, "Market Timing and Selectivity: Na Empirical Investigation of European Mutual Fund Performance ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2016

Punit Limji Panchá, "Financiamento através do Crédito Comercial: Evidência nas (Maiores e Melhores) PME Portuguesas ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2016

Pedro Manuel de Sousa Carita, "A importância da literacia financeira nas decisões de investimento ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2016

João Pedro Martelo Ramos, "Tracking Ability of Global Emerging Markets Exchange Traded Funds", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2015

Ana Rita dos Santos Matilde, "The Hadloven Effect in European Evisty Mutual Funds", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2014

Carolina Maria Henriques Neves Vieira, "Consistência da Performance dos Fundos de Gestão Ativa de Ações Europeias", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2014

João Paulo Matos Heitor Canas, "Imunização do Risco de Taxa de Juro: Um ensaio com obrigações do tesouro português ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2013

Ana Alexandra Afonso Martins, "Eficiência dos Mercados Accionistas Europeus - Efeito Dia-da-Semana", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2012

Cláudia Sofia Gouveia Fonseca, "Gestão Activa Versus Gestão Passiva: Análise Comparativa da Performance dos Exchange Traded Funds", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2012

Marta Rodrigues da Silva Martins de Paula, "Impacto da Crise Sub-Prime no Sector Bancário Português.", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Dissertação de Mestrado, Concluído, 2009

Projecto Final

Tiago Manuel Sousa Oliveirinha, "Interest Rate Swaps: Pratical Issues, Corporate use and Regulation ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2017

Ana Sofia Rodrigues Matos, "Evaluation of EGF: A privatization case", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2013

Pedro Miguel Gião Folgado, "Carteiras de variância mínima no Mercado de Ações Português", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2013

Rui Elias de Faria, "Optimização de Riscos Financeiros em Fundos de Pensões", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2013

Ana Sofia Fonseca Piedade, "Estratégias de Imunização do risco de taxa de juro - Aplicação aos Balanço das Instituições Financeiras", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2012

Liliana Brandão Jerónimo, "All that Glitters is not Gold: Diversification Strategies in Portfolio Management", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2012

Joana Bruno Vieira, "Modelling Volatility: Na assessment of the value at risk approach", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2012

Patrícia Afonso Correia Vargas Tavares, "Impacto da Política Monetária nas Principais Variáveis Macroeconómicas em Portugal ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Gonçalo Paiva da Cunha Lima, "", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Jamila Bárbara Madeira e Madeira, "O Impacte dos Mercados de Capitais na Evolução dos Determinantes Sociopolíticos", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Teresa Mariana Cardeira Martins, "Reverse Mortgage em Portugal uma Opção Viável? ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Tiago Miguel Teixeira Carrazedo, "The Halloween Effect in European Sectors. ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Ramiro Manuel Marques Loureiro, "", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Milene Clementina Morais Costa, "Eventos Internacionais e os Impactos nos Mercados Financeiros ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Cláudia Pereira Correia, "A Relação entre o Mercado de Obrigações e de Credit Default Swaps: O impacto da liquidez e do risco de crédito da contraparte nos preços dos CDS e da dívida pública emitida por países de mercados emergentes ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2011

Gérson Ramiro Gomes Carola, "Caracterização da Evolução da Indústria de Fundos de Investimento Mobiliário em Portugal. ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2010

Paulo José Morgado Lopes Gomes, "A Titularização de Créditos como Meio de Financiamento. ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2010

Francisco José Garcia dos Santos, "Percepção dos Risco Investidores Fundos de Investimento. ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2010

Ricardo Humberto Dias Jorge, "Investir em Ações segundo Warren Buffett: O caso Português. ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2010

Nuno Alexandre da Graça Tomás, "Investimento Imobiliário no Brasil. ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2010

Paula Andreia de Carvalho Patrão de Sá, "OPA do BCP sobre o BPI: Impacto na Negociação Bolsista ", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2010

Pedro Miguel Pedrosa Gomes dos Santos, "A Inevitável Fusão entre a Sonaecom e a Zon.", Luís Alberto Ferreira de Oliveira, Projecto Final, Concluído, 2009

Atividades Científicas

Artigos Científicos em Revistas Internacionais

Oliveira, L., Salen, T., Curto, J. D. & Ferreira, N. (2019). Market timing and selectivity: an empirical investigation of European mutual fund performance. International Journal of Economics and Finance. 11 (2), [Ciência-IUL](#)

Curto, J. D., Oliveira, L. & Matilde, A. R. (2018). The Halloween effect in European equity mutual funds. The Open Journal of Economics and Finance. 2, 20-35, [Ciência-IUL](#)

Carrazedo, T., Curto, J. & Oliveira, L. (2016). The Halloween effect in European sectors. Research in International Business and Finance. 37, 489-500, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

Oliveira, L., Nunes, J. & Malcata, L. (2014). The performance of deterministic and stochastic interest rate risk measures: another question of dimensions?. Portuguese Economic Journal. 13 (3), 141-165, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

Martins, A. & Oliveira, L. (2013). Efeito dia da semana em mercados acionistas internacionais. Revista Portuguesa e Brasileira de Gestão. 12 (2), 14-29, [Ciência-IUL](#)

Oliveira, L., Curto, J. D. & Nunes, J. P. (2012). The determinants of sovereign credit spread changes in the Euro-zone. Journal of International Financial Markets, Institutions & Money. 22 (2), 278-304, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

Nunes, J. P. V. & Oliveira, L. A. F. (2007). Multifactor and analytical valuation of treasury bond futures with an embedded quality option. Journal of Futures Markets. 27 (3), 275-303, [Ciência-IUL](#), Indexada (ISI)

Livros

Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Miguel A. Ferreira & Oliveira, L. (2012). Finanças da Empresa: Teoria e Prática . Lisboa/Portugal. Sílabo., [Ciência-IUL](#)

Mota, António, Barroso, C., Nunes, J. & Miguel A. Ferreira (2011). Finanças da Empresa Teoria e Prática. Portugal. Sílabo., [Ciência-IUL](#)

Publicações

Luís Alberto Ferreira de Oliveira, João Pedro Vidal Nunes (2012) "The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?", Oliveira, L. & Nunes, J. (2012). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. SSRN. 0-0, [Ciência-IUL](#)

Luís Alberto Ferreira de Oliveira, João Pedro Vidal Nunes (2008) "The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures ", Oliveira, L. & Nunes, J. (2008). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures . SSRN. 0-0, [Ciência-IUL](#)

Edição de Livro Científico

Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Miguel A. Ferreira & Oliveira, L. (2012). Finanças da Empresa: Teoria e Prática . Lisboa/Portugal. Sílabo., [Ciência-IUL](#)

Mota, António, Barroso, C., Nunes, J. & Miguel A. Ferreira (2011). Finanças da Empresa Teoria e Prática. Portugal. Sílabo., [Ciência-IUL](#)

Comunicações Internacionais

Apresentação Oral

Oliveira, L., Inácio, P. & Oliveira, C. (2018). ECONOMIC VALUE ADDED ASSESSMENT APPLIED TO THE PORTUGUESE SME DURING THE CRISIS PERIOD. 10th Portuguese Finance Network Conference., [Ciência-IUL](#)

Simões, C, Oliveira, L. & Bravo, J. (2018). Multi Liability Immunization with the M-Absolute Model: an Approach to the 21st Century U.S. Bond Market. 10th Portuguese Finance Network Conference., [Ciência-IUL](#)

Oliveira, L., Matilde, A. & Curto, J. (2015). Halloween Effect in European Mutual Funds. 15th EBES Conference., [Ciência-IUL](#)

Oliveira, L., João Nunes & Malcata, L. (2014). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimensions?. PFN 8th Finance Conference., [Ciência-IUL](#)

Oliveira, L., Curto, J. & Carrazedo, T. (2014). THE HALLOWEEN EFFECT IN EUROPEAN SECTORS. 8th annual meeting of the PEJ., [Ciência-IUL](#)

Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. 7th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal., [Ciência-IUL](#)

Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. FMA Europe 2013 Meeting., [Ciência-IUL](#)

Outras Atividades

Cargos de Gestão Académica

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2014/2014)

Coordenador da unidade curricular Opções Financeiras (Pg) (2014/2014)

Coordenador da unidade curricular Opções Financeiras (Pg) (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Ativos e Passivos_cgd (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Derivados Financeiros_ Cgd (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Ativos e Passivos (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Ativos e Passivos_ Ce (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Análise e Avaliação de Obrigações (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Risco de Mercado (Mf) (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2015/2015)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2016/2016)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2016/2016)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2016/2016)

Coordenador da unidade curricular Risco de Mercado (Mf) (2016/2016)

Coordenador da unidade curricular Análise e Avaliação de Obrigações (2016/2016)

Coordenador da unidade curricular Opções Financeiras (Pg) (2016/2016)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2017/2017)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2017/2017)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2017/2017)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2017/2017)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2018/2018)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2018/2018)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2018/2018)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2018/2018)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2019/2019)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2019/2019)

Coordenador da unidade curricular Finanças de Empresa (2019/2019)

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos Financeiros (2020/2020)