

## Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira

### Perfil



**Departamento** Departamento de Métodos Quantitativos para Gestão e Economia

**E-mail** nuno.ferreira@iscte-iul.pt

**Categoria** Professor Auxiliar

**Gabinete** AA1.08

**Cacifo** 171

**Telefone** 217650211

**Currículo DeGóis** [Consultar o currículo DeGóis](#)

**Perfil no ORCID** [Consultar o perfil ORCID](#)

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

### Interesses de Ensino e Investigação

- Econometria dos Mercados Financeiros
- Modelos de transição suaves
- Modelos Global VAR
- Cointegração de series temporais

### Qualificações

Tipo	Programa	Instituição	Ano
Doutoramento	Gestão	ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	2005
Mestrado	Ciências Empresariais	ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	1997
Licenciatura	Organização e Gestão de Empresas	ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	1994

### Atividades Académicas

#### Unidades curriculares

[Econometria dos Mercados Financeiros](#)

### Orientações

## Dissertação de mestrado

Bernardo Maria Mestre Acácio Lopes, "Mercado Bolsista e a sua Integração para os Mercados da Zona EuroMercado Bolsista e a sua Integração para os Mercados da Zona Euro", Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira, Dissertação de mestrado, Concluído, 2017

Tomás Coutinho Grosso de Oliveira Salen, "Market Timing and Selectivity: Na Empirical Investigation of European Mutual Fund Performance ", Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira, Dissertação de mestrado, Concluído, 2016

## Projecto final

Frederico Freire de Barbosa Bacelar de Meireles, "Qual o Impacto do Serviço M4O no Mercado das Telecomunicações e na Liderança da PT?", Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira, Projecto final, Concluído, 2015

## Dissertação de mestrado

Diogo Lopes Pinheiro, "Fusões e Aquisições Transnacionais: uma análise empírica do caso Arcelor Mittal", Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira, Dissertação de mestrado, Concluído, 2012

## 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](#)

Ferreira, N. (2018). Macro-financial linkages between emergent and sustainable economies in a context of the European sovereign debt crisis. Archives of Business Research. 6 (8), 109-121, [Ciência-IUL](#)

Oliveira, M. M., Camanho, A. S., Walden, J. B., Miguéis, V. L., Ferreira, N. B. & Gaspar, M. B. (2017). Forecasting bivalve landings with multiple regression and data mining techniques: the case of the Portuguese artisanal dredge fleet. Marine Policy. 84, 110-118, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

Ferreira, N. B. & Oliveira, M. M. (2016). Portfolio efficiency analysis with SFA: the case of PSI-20 companies. Applied Economics. 48 (1), 1-6, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

Ferreira, N. & Souza, A. M. (2015). Efficiency in stock markets with DEA: evidence from PSI20. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 5 (1), 861-865, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N. B. & Oliveira, M. M. (2014). An analysis of equity markets cointegration in the european sovereign debt crisis. Open Journal of Finance. 1 (1), 40-48, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N. B., Souza, F. M. & Souza, A. (2014). PSI-20 portfolio efficiency analysis with SFA. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 4 (3), 785-789, [Ciência-IUL](#)

Bentes, S. & Ferreira, N. B. (2014). Modeling long memory in the EU stock market: evidence from the STOXX 50 returns. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 4 (3), 778-784, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N. B., Menezes, R. & Bentes, S. (2014). Cointegration and Structural Breaks in the EU Sovereign Debt Crisis. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 4 (1), 680-690, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N. B., Rocha, L., Souza, A. & Santos, E. (2014). Box-Jenkins and volatility models for Brazilian ?Selic? interest and currency rates. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 4 (3), 766-773, [Ciência-IUL](#)

Bentes, S.R., Menezes, R. & Ferreira, N.B. (2013). On the asymmetric behaviour of stock market volatility: evidence from three countries. International Journal of Academic Research. 5 (4), 24-32, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N., Menezes, R. & Bentes, S. (2013). Globalization, regime-switching, and EU stock markets: the impact of the sovereign debt crises. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 3 (3), 556-562, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N., Menezes, R. & Bentes, S. (2013). Cointegration and structural breaks in the PIIGS economies. International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences. 3 (4), 611-617, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N., Menezes, R. & Oliveira, M. M. (2013). Structural breaks and cointegration analysis in the EU developed markets. *International Journal of Latest Trends in Finance and Economics Sciences*. 3 (4), 652-661, [Ciência-IUL](#)

Souza, A., Souza, F., Ferreira, N. B. & Menezes, R. (2011). Electrical energy supply for Rio Grande do Sul, Brazil, using forecast combination of weighted eigenvalues. *Gestão da Produção, Operações e Sistemas*. 6 (3), 23-39, [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N. B., Menezes, R. & Mendes, D. A. (2007). Asymmetric conditional volatility in international stock markets. *Physica A*. 382 (1), 73-80, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

Menezes, R., Ferreira, N.B. & Mendes, D.A. (2006). Co-movements and asymmetric volatility in the Portuguese and U.S. stock markets. *Nonlinear Dynamics*. 44 (1-4), 359-366, [Ciência-IUL](#), Indexada (SCOPUS/ISI)

## Capítulos de Livros

Diana Elisabeta Aldea Mendes, Vivaldo Manuel Pereira Mendes, Nuno Rafael Barbosa de Jesus Ferreira, Rui Manuel Campilho Pereira de Menezes (2010) "Symbolic shadowing and the computation of entropy for observed time series", Springer Japan Mendes, D. A., Mendes, V., Ferreira, N. B. & Menezes, R. (2010). Symbolic shadowing and the computation of entropy for observed time series. *Econophysics Approaches to Large-Scale Business Data and Financial Crisis*. 227-246, [Ciência-IUL](#)

## Comunicações Publicadas em Acta de Conferências

Ferreira, N. B. (2016). Insights into portuguese stock market efficiency using DEA. In Roslind X. Thambusamy, Melis Y. Minas, Zafer Bekirogullari (Ed.), *The European Proceedings of Social and Behavioural Sciences*. (pp. 367-373). Selangor: Future Academy., [Ciência-IUL](#)

Ferreira, N. B. & Oliveira, M.M. (2015). Untangling hotel industry's inefficiency: an SFA approach applied to a renowned Portuguese hotel chain. In 9th International Conference on Computational and Financial Econometrics