

Curriculum Vitae

João Pedro Vidal Nunes

Julho de 2014

Conteúdo

1	Dados pessoais	3
2	Graus académicos	3
3	Vínculos profissionais	4
4	Actividades pedagógicas	5
4.1	Actividade docente	5
4.1.1	Unidades curriculares leccionadas	5
4.1.2	Serviço docente actual	7
4.1.3	Avaliação do desempenho pedagógico	7
4.1.4	Prémios de desempenho pedagógico	8
4.2	Actividades de inovação pedagógica	8
4.3	Orientações	9
4.3.1	Orientações de doutoramento	9
4.3.2	Orientações de mestrado	10
4.4	Publicações pedagógicas	17
4.4.1	Livros	17
4.4.2	Sebentas	17
5	Actividades de investigação científica	18
5.1	Produção científica	18
5.1.1	Artigos publicados em revistas com arbitragem científica	18

5.1.2	Outros artigos	19
5.1.3	Apresentação de artigos científicos em conferências com referees . . .	20
5.1.4	Discussões de artigos científicos em conferências com referees	23
5.1.5	Organização de eventos científicos	24
5.2	Projectos científicos	24
5.3	Coordenação e liderança científica	24
5.4	Avaliação científica	25
5.4.1	Participação no júri de graus académicos	25
5.4.2	Provas de agregação	34
5.4.3	Refereeing em jornais académicos internacionais	35
6	Extensão universitária	36
6.1	Acções de formação para empresas	36
6.2	Actividades de consultoria	36
7	Serviço à instituição	36

Lista de Tabelas

1	Unidades curriculares leccionadas e coordenadas no ano lectivo de 2013/14 .	7
2	Desempenho pedagógico nas licenciaturas	38
3	Desempenho pedagógico nos mestrados	39
4	Desempenho pedagógico nas pós-graduações	40

1. Dados pessoais

1. Nome completo: João Pedro Vidal Nunes.
2. Data de Nascimento: 05 de Fevereiro de 1968.
3. Sexo: Masculino.
4. Bilhete Identidade: 7732631.
5. Nacionalidade: Portuguesa.
6. Estado Civil: Casado (duas filhas).
7. Nome em citações bibliográficas: J. Nunes.
8. Categoria profissional: Professor catedrático do ISCTE-IUL.
9. Domínio científico de actuação: Finanças e Matemática Financeira.
10. Endereço profissional: ISCTE-IUL, Gabinete D531, Edifício 2, Av. Professor Aníbal Bettencourt, 1600-189 Lisboa, Portugal.
11. Correio electrónico: joao.nunes@iscte.pt.
12. Homepage: <http://iscte.pt/~jpv>.

2. Graus académicos

1. *Agregação* em Finanças no ISCTE-IUL (2008).
2. *Ph.D. em Finanças* na Universidade de Warwick, Inglaterra (1995-2000). Título da dissertação: “Exponential-Affine Diffusion Term Structure Models: Dimension, Time-Homogeneity, and Stochastic Volatility”. Supervisores: Prof. Les Clewlow e Prof. Stewart Hodges. Examinadores: Prof. Stephen Schaefer (London Business School) e Prof. Joanne Kennedy (University of Warwick). Bolsa de doutoramento da Fundação

de Ciência e Tecnologia com o número PRAXISXXI/BD/5712/95 recebida durante o programa doutoral.

3. *Mestrado em Economia Monetária e Financeira* (1991-94) no Instituto Superior de Economia e Gestão (ISEG). Parte escolar concluída em 1992 com a média final de 16 valores. Tese de dissertação intitulada “Valuation Models for Options on Treasury Bonds” e classificada com Muito Bom em Fevereiro de 1994. Supervisor: Prof. Mário Patinha Antão. Examinadores: Prof. António Gomes Mota (ISCTE) e Prof. Carlos Pereira da Silva (ISEG). Prémio Montepio Geral para o melhor aluno do curso.
4. *Licenciatura em Organização e Gestão de Empresas* (1985-90) no Instituto Superior de Ciências do Trabalho e da Empresa (ISCTE), concluída com a classificação final de 16 valores. Prémio Banco Totta & Açores para o melhor aluno do curso.

3. Vínculos profissionais

1. Vínculos e responsabilidades actuais:
 - (a) Professor catedrático do ISCTE-IUL desde 2012.
 - (b) Director do mestrado executivo em *Mercados e Activos Financeiros* da ISCTE-IUL Business School (IBS) desde 2000. (<http://indeg.iscte.pt/?pt=Mestrado-Mercados-Activos-Financeiros>).
 - (c) Co-director do mestrado em Matemática Financeira da ISCTE-IUL Business School (IBS) e da FCUL (<http://matfin.fc.ul.pt/>) desde 2005.
2. De 2008 a 2012: Professor associado com agregação e nomeação definitiva do ISCTE-IUL.
3. De 2007 a 2014: Director do Departamento de Finanças do ISCTE-IUL.
4. De 2007 a 2013: Coordenador dos mestrados executivos em Finanças da ISCTE-IUL Business School (IBS).

5. De 2006 a 2008: Professor associado com nomeação definitiva do ISCTE-IUL.
6. De 2005 a 2006: Professor auxiliar com nomeação definitiva do ISCTE-IUL.
7. De 2000 a 2005: Professor auxiliar do ISCTE-IUL.
8. De 1996 a 1999: Assistente do ISCTE-IUL com equiparação a bolseiro.
9. De 1992 a 1996: Assistente do ISCTE-IUL.
10. De 1991 a 1992:
 - (a) Assistente do ISCTE-IUL.
 - (b) Analista de mercados monetários e cambiais na corretora SIEMCA, SA.

4. Actividades pedagógicas

4.1. Actividade docente

4.1.1. Unidades curriculares leccionadas

1. Docente da unidade curricular de *Gestão Financeira* da licenciatura em Organização e Gestão de Empresas, no ISCTE-IUL, de 1990 a 1995.
2. Coordenador e docente da unidade curricular de *Investimentos* da licenciatura em Finanças e Contabilidade, no ISCTE-IUL, desde o ano lectivo de 1999/2000.
3. Coordenador e docente da unidade curricular de *Gestão Financeira I* da licenciatura em Organização e Gestão de Empresas, no ISCTE-IUL, de 2003/04 a 2005/06.
4. Coordenador e docente da unidade curricular de *Investimentos* da licenciatura em Gestão, no ISCTE-IUL, desde o ano lectivo de 2006/07.
5. Docente e coordenador da unidade curricular de *Investments* do Programa Sócrates-Erasmus, no ISCTE-IUL, nos anos lectivos de 1999/2000 a 2001/02.

6. Docente da unidade curricular de *Teoria e Gestão do Risco* no mestrado em Finanças do ISCTE-IUL, de 1994 a 1995.
7. Docente e coordenador da unidade curricular de *Modelos de Decisão Financeira* do mestrado em Finanças, no ISCTE-IUL, nos anos lectivos de 1999/2000 e 2000/01.
8. Docente e coordenador da unidade curricular de *Modelos de Taxa de Juro* do mestrado em Finanças, no ISCTE-IUL, no ano lectivo de 2000/01.
9. Docente e coordenador da unidade curricular de *Investimentos Financeiros* do mestrado em Finanças, no ISCTE-IUL, nos anos lectivos de 2001/02 a 2003/04.
10. Coordenador e docente da unidade curricular de *Complementos de Opções* do mestrado em Finanças, no ISCTE-IUL, nos anos lectivos de 2001/02, 2005/06 e 2006/07.
11. Coordenador e docente da unidade curricular de *Opções Financeiras* do mestrado em Finanças, no ISCTE-IUL, nos anos lectivos de 2004/05, 2005/06, 2006/07 e 2009/10.
12. Coordenador e docente da unidade curricular de *Opções Exóticas* do mestrado em Matemática Financeira, no ISCTE-IUL, desde o ano lectivo de 2005/06.
13. Coordenador e docente da unidade curricular de *Modelos de Estrutura Temporal de Taxas de Juro* do mestrado em Matemática Financeira, no ISCTE-IUL, desde o ano lectivo de 2005/06.
14. Coordenador e docente da unidade curricular de *Continuos-Time Finance* do programa doutoral em Finanças, no ISCTE-IUL, desde o ano lectivo de 2008/09.
15. Docente dos cursos de pós-graduação de Mercados e Activos Financeiros (MAF), Corporate Finance (CF) e Gestão de Instituições Financeiras (GIF) do INDEG/ISCTE, desde 1995, tendo leccionado as disciplinas de *Análise e Avaliação de Obrigações, Gestão de Activos e Passivos, Derivados de Taxas de Juro, Inovação Financeira e Produtos Estruturados e Opções Financeiras*.

16. Docente dos cursos de especialização em Mercados Financeiros (MF) e Corporate Finance Aplicado (CFA) do INDEG/ISCTE, de 1999 a 2001, tendo leccionado as disciplinas de *Mercados Obrigacionistas* e *Mercados de Opções*.
17. Docente da unidade curricular de *Banking Management and Strategy* do MBA em Banking and Finance, na Faculty of Business Administration – University of Macau, no ano lectivo de 2000/2001.

4.1.2. Serviço docente actual

A Tabela 1 resume as unidades curriculares leccionadas e coordenadas no corrente ano lectivo (2013/14) e também previstas para o ano lectivo de 2014/15.

Tabela 1: Unidades curriculares leccionadas e coordenadas no ano lectivo de 2013/14

Unidade curricular	Curso	Nº. Turmas	Horas por semana/ano
Investimentos	Lic. Gestão	1	2.25
Investimentos	Lic. Finanças e Cont.	2	4.5
Opções Exóticas	MSc. Matemática Fin.	1	1.25
Modelos Estr. Temp. Taxas Juro	MSc. Matemática Fin.	1	1.25
Continuous-Time Finance	Phd. Finance	1	1
		Total	10.25

4.1.3. Avaliação do desempenho pedagógico

As Tabelas 2, 3 e 4 resumem o resultado dos inquéritos efectuados aos alunos de Licenciatura, Mestrado e Pós-Graduação acerca do meu desempenho pedagógico.

4.1.4. Prémios de desempenho pedagógico

1. Prémio de melhor docente do mestrado executivo em Mercados e Activos Financeiros nos anos lectivos de 2008/09, 2009/10, 2010/11 e 2012/13.
2. Prémio de melhor docente do mestrado executivo em Corporate Finance no ano lectivo de 2008/09.

4.2. Actividades de inovação pedagógica

1. Elaboração, em 2012, do processo de acreditação do mestrado executivo em *Mercados e Activos Financeiros* da ISCTE-IUL Business School junto da *Global Association of Risk Professionals* (GARP), culminando com o reconhecimento do curso como sendo um *GARP Academic Partner*.
2. Coordenação do processo de reestruturação, em 2009, dos actuais mestrados executivos em Finanças da ISCTE-IUL Business School, culminando com a passagem destes de 42 para 60 ECTS.
3. Participação no processo de reestruturação, em 2007, da actual licenciatura em Finanças e Contabilidade do ISCTE-IUL.
4. Criação da unidade curricular de *Continuous-Time Finance* no programa doutoral em Finanças do ISCTE-IUL, no ano lectivo de 2008/09.
5. Participação no processo de criação, em 2005 e juntamente com os Professores Miguel Ramos e Isabel Simão da FCUL, do mestrado em Matemática Financeira do ISCTE-IUL e da FCUL.
6. Criação da unidade curricular de *Opções Exóticas* no mestrado em Matemática Financeira do ISCTE-IUL e FCUL, no ano lectivo de 2005/06.
7. Criação da unidade curricular de *Modelos de Estrutura Temporal de Taxas de Juro* no mestrado em Matemática Financeira do ISCTE-IUL e FCUL, no ano lectivo de 2005/06.

8. Criação da unidade curricular de *Investimentos Financeiros* no mestrado em Finanças do ISCTE-IUL, no ano lectivo de 2001/02.
9. Criação da unidade curricular de *Complementos de Opções* no mestrado em Finanças do ISCTE-IUL, no ano lectivo de 2001/02.
10. Criação da unidade curricular de *Investimentos* nas licenciaturas em Gestão e em Finanças do ISCTE-IUL, no ano lectivo de 2001/02.
11. Criação da unidade curricular de *Modelos de Taxa de Juro* no mestrado em Finanças do ISCTE-IUL, no ano lectivo de 2000/01.
12. Criação da unidade curricular de *Inovação Financeira e Produtos Estruturados* no curso de pós-graduação de Mercados e Activos Financeiros (MAF) do INDEG/ISCTE, no ano lectivo de 2000/01.
13. Criação da unidade curricular de *Modelos de Decisão Financeira* no mestrado em Finanças do ISCTE-IUL, no ano lectivo de 1999/2000.
14. Criação da unidade curricular de *Opções Financeiras* nos cursos de pós-graduação de Mercados e Activos Financeiros (MAF) e de Corporate Finance (CF) do INDEG/ISCTE, no ano lectivo de 1995/96.
15. Criação em 1995 e em conjunto com os professores António Gomes Mota e Miguel Ferreira do Curso de pós-graduação em Mercados e Activos Financeiros, organizado pelo CEMAF – Centro de Investigação em Mercados e Activos Financeiros do ISCTE, a primeira pós-graduação na área oferecida em Portugal.

4.3. Orientações

4.3.1. Orientações de doutoramento

1. Co-orientação (com o Prof. José Carlos Dias) da tese de doutoramento do mestre João Pedro Ruas, com vista à obtenção do grau de doutor em Finanças pelo ISCTE-IUL e

intitulada “Three Essays on the Valuation of American-style Options”. Arguência dos Profs. Isabel Simão, Manuel Esquível e Nelson Areal em Julho de 2013.

2. Orientação da tese de doutoramento do mestre Luís Alberto Ferreira de Oliveira, com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão (com especialização em Finanças) pelo ISCTE e intitulada “Theoretical and Empirical Essays on the HJM Framework”. Arguência dos Profs. José Soares da Fonseca, Ana Paula Matias Gama e José Dias Curto em Dezembro de 2007.
3. Orientação em curso da tese de doutoramento do mestre Pedro Prazeres, com vista à obtenção do grau de doutor em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Essays on Interest Rate Option Pricing under Multifactor Term Structure Models”.

4.3.2. Orientações de mestrado

1. Orientação da tese de mestrado do licenciado Pedro Simões Oliveira, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “The Convolution Method for Pricing American Options under Lévy Processes”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Abril de 2014.
2. Orientação da tese de mestrado do licenciado Igor Kravchenko, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Barrier Option Pricing via Heston Model”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Dezembro de 2013.
3. Orientação da tese de mestrado do licenciado André Filipe Figueira de Sousa, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Superfícies de Volatilidade”. Arguência do Prof. João Costa em Dezembro de 2013.
4. Orientação da tese de mestrado do licenciado Rui Filipe da Silva Monteiro, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Option Pricing with Lévy Processes: Jump models for European-style options”. Arguência do Prof. Szabolcs Sebestyén em Dezembro de 2013.

5. Orientação da tese de mestrado da licenciada Ana Raquel dos Santos Cabral Sacadura, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Avaliação de Opções Barreira segundo o Modelo CEV”. Arguência do Doutor João Pedro Ruas em Novembro de 2013.
6. Orientação da tese de mestrado da licenciada Sara Veloso, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “O Modelo Fiscal de Avaliação de Prédios Urbanos e o Ciclo Económico do País”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Julho de 2013.
7. Orientação da tese de mestrado da licenciada Ana Margarida David Domingues, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “The Valuation of Turbo Warrants under the CEV Model”. Arguência do Prof. Manuel Esquível em Dezembro de 2012.
8. Orientação da tese de mestrado do licenciado Tiago Miguel Vargas Tavares, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Modelos de Taxa de Juro após a Crise de Crédito e Liquidez”. Arguência do Prof. Pedro Leite Inácio em Janeiro de 2012.
9. Orientação da tese de mestrado do licenciado Gonçalo Nuno Henriques Mendes, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Valuation of Barrier Options through Trinomial Trees”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Dezembro de 2011.
10. Orientação da tese de mestrado da licenciada Arne Neumann, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Assembly and Preparation for the Derivative Market - A Convenience Comparison Between Financial Options and Futures with View to the Eurex and Liffe”. Arguência do Prof. Luís Oliveira em Junho de 2011.
11. Orientação da tese de mestrado da licenciada Iva Bagic, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Single and Combined Option Trading Strategies”. Arguência do Prof. Pedro Leite Inácio em Junho de 2011.

12. Orientação da tese de mestrado do licenciado William Hilebrand, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “The Valuation of Callable Defaultable Bonds”. Arguência do Prof. João Pedro Pereira em Junho de 2011.
13. Orientação da tese de mestrado elaborada por Vera Cristina Vaz Antunes, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Quality and Timing Option Value in US Treasury Bond Futures”. Arguência do Prof. Luís Oliveira em Abril de 2011.
14. Orientação da tese de mestrado elaborada por Jorge Alexandre Rodrigues Domingues, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Definição de Carteiras de Investimento para Investidores Particulares de Património Elevado”. Arguência do Prof. João Pedro Pereira em Janeiro de 2011.
15. Orientação da tese de mestrado elaborada por Luís Filipe Dôres Veiga, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Imunização de Portfolios de Empréstimos à Habitação a Taxa Fixa”. Arguência do Prof. Luís Oliveira em Janeiro de 2011.
16. Orientação da tese de mestrado elaborada por Filipa Isabel Alcaide, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Covered Bond Market – Is Legislation determinant to investors decision?”. Arguência do Prof. Pedro Leite Inácio em Janeiro de 2011.
17. Orientação da tese de mestrado da licenciada Lúcia Ventura, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Opções com monitorização discreta da barreira”. Arguência do Prof. Manuel Esquível em Dezembro de 2010.
18. Orientação da tese de mestrado do licenciado Pedro Miguel Silva Prazeres, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Valuation of European-style Swaptions”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Dezembro de 2010.

19. Orientação da tese de mestrado da licenciada Maria Madalena Rodrigues Ribeiro, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Avaliação de opções Americanas via Simulação de Monte Carlo”. Arguência da Prof. Diana Mendes em Dezembro de 2010.
20. Orientação da tese de mestrado da licenciada Ana Filipa Monteiro Leite Marques Xavier, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Avaliação de Double Barrier Options”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Dezembro de 2010.
21. Orientação da tese de mestrado elaborada por Maria da Graça Teixeira Duarte Câmara, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “O efeito smile: Uma aplicação ao DAX”. Arguência do Prof. João Pedro Pereira em Julho de 2010.
22. Orientação da tese de mestrado elaborada por Cláudia Patrícia Gonçalves Simões, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Euro Area Inflation-Linked Bonds Market: Analysis and immunization abilities”. Arguência do Prof. Luís Oliveira em Janeiro de 2010.
23. Orientação da tese de mestrado elaborada por Diogo Monteiro da Costa Soares Justino, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Hedging of Barrier Options”. Arguência do Prof. João Pedro Pereira em Janeiro de 2010.
24. Orientação da tese de mestrado da licenciada Rita Duarte Pimentel, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Avaliação de Opções Americanas com condições de barreira”. Arguência do Prof. Carlos Veiga em Dezembro de 2009.
25. Orientação da tese de mestrado da licenciada Ana Cristina Alves Ventura, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Avaliação de Insurance Linked Bonds com Taxas de Juro Estocásticas”. Arguência do Prof. Luís Oliveira em Dezembro de 2009.

26. Orientação da tese de mestrado do licenciado Miguel João Montenegro Silva, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “(LI)BOR: one model again”. Arguência do Prof. João Pedro Pereira em Dezembro de 2009.
27. Orientação da tese de mestrado do licenciado Sérgio Miguel Abreu Ferreira, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “Barrier Options under the CEV Diffusion”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Novembro de 2009.
28. Orientação da tese de mestrado da licenciada Andrea Sofia Meireles Rodrigues, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE-IUL e pela FCUL e intitulada “The Quality Option for Treasury Inflation-Linked Bond Futures”. Arguência da Prof^a. Raquel Gaspar em Novembro de 2009.
29. Orientação da tese de mestrado elaborada por Fernando Manuel de Deus Infante, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Basileia II: Análise das Implicações do Pilar 2 na Organização do Processo de Supervisão”. Arguência do Prof. João Pedro Pereira em Julho de 2009.
30. Orientação da tese de mestrado elaborada por Carina Sofia Ferreira da Silva, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “O Mercado Organizado de CO₂ – Oportunidade de Investimento e Melhoria do Ambiente - Compatíveis?”. Arguência do Prof. Pedro Leite Inácio em Julho de 2009.
31. Orientação da tese de mestrado do licenciado Hugo Miguel Fernandes Marques, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE e pela FCUL e intitulada “The Heston Model under Stochastic Interest Rates”. Arguência do Prof. Manuel Equível em Dezembro de 2008.
32. Orientação da tese de mestrado do licenciado Tiago Ramalho Viegas Alcaria, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE e pela FCUL e intitulada “Fourier Transform Methods for Option Pricing”. Arguência da Prof^a. Cláudia Ribeiro em Dezembro de 2008.

33. Orientação da tese de mestrado da licenciada Ana Rita Marques Bárbaro, com vista à obtenção do grau de mestre em Matemática Financeira pelo ISCTE e pela FCUL e intitulada “Pricing Barrier Options under the Heston Model”. Arguência da Prof^a. Andreia Dionísio em Dezembro de 2008.
34. Orientação da tese de mestrado elaborada por Luís Manuel David Freitas Gonçalves, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Valuation of European Barrier Options on Stocks under Stochastic Interest Rates”. Arguência do Prof. José Carlos Dias em Novembro de 2007.
35. Orientação da tese de mestrado elaborada por Luís Miguel Teixeira Malcato, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Empirical Analysis of the Efficiency of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures”. Arguência da Prof^a. Raquel Gaspar em Novembro de 2007.
36. Orientação da tese de mestrado elaborada por Teresa Maria Matos Lemos, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Consistência entre Modelos de Equilíbrio dos Mercados Financeiros e Modelos de Avaliação de Opções”. Arguência da Prof^a. Isabel Maria Pereira Viegas Vieira em Abril de 2007.
37. Orientação da tese de mestrado elaborada por Ricardo Alexandre Afonso Martins, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Importância da Capacidade de Concessão de Crédito para a Avaliação do Risco de Taxa de Juro das Instituições de Crédito”. Arguência do Prof. José Azevedo Pereira em Abril de 2007.
38. Orientação da tese de mestrado elaborada por João Eduardo Monteiro Rodrigues, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Pricing TIPS under an Unified Affine Gaussian Model for Nominal and Real Interest Rates”. Arguência do Prof. Miguel St. Aubyn em Novembro de 2006.
39. Orientação da tese de mestrado elaborada por Sara dos Santos Rodrigues de Areia, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Kalman

Filtering of IRS Curves: The Linear versus the Non-linear Approach”. Arguência do Prof. António Saragga Seabra em Outubro de 2006.

40. Orientação da tese de mestrado elaborada por Tânia Teixeira, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “A Credit Default Swap Model with Counterparty Risk”. Arguência do Prof. Jorge Barros Luís em Março de 2006.
41. Orientação da tese de mestrado elaborada por Jorge Miguel Fernandes Nascimento, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Dimensão e Especificação de Volatilidades e Correlações para Lognormal LIBOR Market Models: Uma Avaliação Empírica”. Arguência do Prof. António Saragga Seabra em Dezembro de 2004.
42. Orientação da tese de mestrado elaborada por Maria Isabel Lopes Soares, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Kalman Filtering of Affine Term Structure Models with Macro State Variables”. Arguência do Prof. Carlos Pereira da Silva em Novembro de 2004.
43. Orientação da tese de mestrado elaborada por Sofia Nú Oliveira, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Empirical Analysis of the US Primary Market for Range Notes”. Arguência do Prof. Carlos Pereira da Silva em Junho de 2003.
44. Orientação da tese de mestrado elaborada por Luís Alberto Ferreira de Oliveira, com vista à obtenção do grau de mestre em Finanças pelo ISCTE e intitulada “The Quality Option Implicit in Treasury Bond Futures Contracts: A Theoretical and Empirical Assessment”. Arguência do Prof. João Amaro de Matos em Dezembro de 2000.

4.4. Publicações pedagógicas

4.4.1. Livros

1. Ferreira, M., A. Gomes Mota, J. Nunes, e outros (1995): *Gestão Financeira: Casos Práticos*, edições CEMAF.
2. Gomes Mota, A., C. Barroso, J. Nunes e M. Ferreira (2012): *Finanças Empresariais: Teoria e Prática*, Publisher Team, 4^a edição.
3. Gomes Mota, A., C. Barroso, D. Pimentel, J. Lourenço, J. Nunes, L. Oliveira, M. Ferreira e R. Alpalhão (2012): *Investimentos Financeiros: Teoria e Prática*, Publisher Team, 2^a edição.

4.4.2. Sebentas

1. Sebenta da unidade curricular de *Investimentos* das licenciaturas em Finanças e Contabilidade e em Gestão, no ISCTE-IUL.
2. Sebenta da unidade curricular de *Opções Exóticas* do mestrado em Matemática Financeira, no ISCTE-IUL.
3. Sebenta da unidade curricular de *Modelos de Estrutura Temporal de Taxas de Juro* do mestrado em Matemática Financeira, no ISCTE-IUL.
4. Sebenta da unidade curricular de *Opções Financeiras* do mestrado em Finanças, no ISCTE-IUL.
5. Sebenta da unidade curricular de *Continuous-Time Finance* do programa doutoral em Finanças, no ISCTE-IUL.
6. Sebenta da unidade curricular de *Gestão de Activos e Passivos* do mestrado executivo em Mercados e Activos Financeiros, no INDEG/ISCTE.
7. Sebenta da unidade curricular de *Inovação Financeira e Produtos Estruturados* do mestrado executivo em Mercados e Activos Financeiros, no INDEG/ISCTE.

5. Actividades de investigação científica

5.1. Produção científica

5.1.1. Artigos publicados em revistas com arbitragem científica

1. Nunes, J., J. Ruas and J. Dias (2013): "Pricing and Static Hedging of American-style Options under the Jump to Default Extended CEV Model", *Journal of Banking and Finance* 37, 4059-4072.
2. Nunes, J., and P. Prazeres (2013): "Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models", *Mathematical Finance*, forthcoming.
3. Nunes, J., L. Oliveira and J. Dias Curto (2012): "The Determinants of Sovereign Spread Changes in the Euro-zone", *Journal of International Financial Markets, Institutions & Money* 22, 278-304.
4. Nunes, J. (2011): "American Options and Callable Bonds under Stochastic Interest Rates and Endogenous Bankruptcy", *Review of Derivatives Research* 14, 283-332.
5. Nunes, J. and J. Dias (2011): "Pricing Real Options under the Constant Elasticity of Variance Diffusion", *Journal of Futures Markets* 31, 230-250.
6. Nunes, J. (2009): "Pricing American Options under the Constant Elasticity of Variance Model and Subject to Bankruptcy", *Journal of Financial and Quantitative Analysis* 44, 1231-1263. Referee: Ren-Raw Chen (Fordham University).
7. Nunes, J. and L. Oliveira (2007): "Multi-Factor and Analytical Valuation of Treasury Bond Futures with an Embedded Quality Option", *Journal of Futures Markets* 27, 275-303.
8. Nunes, J. (2006): "Barrier Options on Spot LIBOR Rates under Multi-Factor Gaussian HJM Models", *Journal of Derivatives*, Fall, 61-81.

9. Nunes, J. (2004): “Multi-Factor Valuation of Floating Range Notes”, *Mathematical Finance* 14, 79-97.
10. Nunes, J. (2004): “A General Equilibrium Framework for the Affine Class of Term Structure Models”, *Portuguese Economic Journal* 3, 15-48.
11. Pereira da Silva, C., J. Nunes and J. Cadete (2003): “The Immunisation of a Workers’ Compensation Fund”, *Boletim do Instituto dos Actuários Portugueses* 42, 11-39.
12. Nunes, J., L. Clewlow, and S. Hodges (1999): “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: An Arrow-Debreu Pricing Approach”, *Review of Derivatives Research* 3, 5-66. Referees: Darrell Duffie (Stanford University) and Qiang Dai (University of North Carolina).
13. Nunes, J. (1998): “Interest Rate Options in a Duffie-Kan Model with Deterministic Volatility”, *Portuguese Review of Financial Markets* 1, 63-101.

Estão assinalados a *bold* os cinco artigos científicos que considero mais representativos da actividade desenvolvida na área disciplinar de Finanças.

5.1.2. Outros artigos

1. Nunes, J. (2011): “Taxas de juro e índices bolsistas”, *Jornal de Negócios*.
2. Nunes, J. (2010): “Contabilidade pública criativa”, *Jornal de Negócios*.
3. Nunes, J. (1994): “Gestão dos Riscos de Taxa de Juro e de Câmbio”, *Revista da Aula do Comércio* 15, 10-13.
4. Nunes, J. (1994): “Derivados Financeiros e Empresas”, *Expresso*.
5. Gomes Mota, A., e J. Nunes (1993): “Avaliação de Aplicações Financeiras de Curto Prazo”, *Revista ISCTE/Gestão* 1, 13-15.
6. Nunes, J. (1992): “As Obrigações do Tesouro Médio Prazo e as Taxas de Juro a Prazo”, *Revista Dinâmica Gestão*, 13-15.

7. Nunes, J. (1991): “Indexante FIP versus Taxas APB”, *Revista de Gestão* 10, 23-27.

5.1.3. Apresentação de artigos científicos em conferências com referees

1. Bachelier Finance Society Conference, “Static Hedging and Early Exercise Boundaries for American-style Barrier Options”, Bruxelas, Junho 2014.
2. 7th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal, “The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?”, Covilhã, July 2013.
3. FMA Europe 2013 Meeting, “The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?”, Luxembourg, June 2013.
4. SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering, “Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models”, Minneapolis, Minnesota, USA, Julho 2012.
5. EFMA 2012 Meeting, “The Implied Volatility Bias: A No-Arbitrage Approach for Short-Dated Options”, Barcelona, Junho 2012.
6. Mathematical Finance Days 2012 Meeting, “Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models”, Montreal, Canada, Maio 2012.
7. International Conference on Mathematical Finance and Economics, “Valuation of Forward Start Options under Affine Jump-Diffusion Models”, Istanbul, Julho 2011.
8. SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering, “American Options and Callable Bonds under Stochastic Interest Rates and Endogenous Bankruptcy”, São Francisco, Novembro 2010.
9. Bachelier Finance Society Conference, “Valuation of Forward Start Options under Affine Jump-Diffusion Models”, Toronto, Junho 2010.
10. Derivatives Securities Conference, “Analytical Valuation of American Options and Callable Bonds under Stochastic Interest Rates and Endogenous Bankruptcy”, Arlington, Abril 2009.

11. Portuguese Finance Network Conference, “Analytical Valuation of American Options under Stochastic Interest Rates: An Optimal Stopping Approach”, Coimbra, Julho 2008.
12. Portuguese Finance Network Conference, “Pricing Real Options under the CEV Diffusion”, Coimbra, Julho 2008.
13. Portuguese Finance Network Conference, “The Determinants of Sovereign Credit Spread Changes in the Euro-Zone”, Coimbra, Julho 2008.
14. EFMA Conference, “A General Characterization of the Early Exercise Premium”, Vienna, Junho 2007.
15. Bachelier Finance Society Conference, “A General Characterization of the Early Exercise Premium”, Tokyo, Agosto 2006.
16. Derivatives Securities Conference, “A General Characterization of the Early Exercise Premium”, Arlington, Abril 2006.
17. International Conference on Stochastic Finance, “Barrier Options on Spot LIBOR Rates under Multi-Factor Gaussian HJM Models”, Lisboa, Setembro 2004.
18. European Finance Association Conference, “Multi-Factor and Analytical Valuation of Treasury Bond Futures with an Embedded Quality Option”, Maastricht, Agosto 2004.
19. German Finance Association (DGF) Conference, “Quasi-Analytical Multi-Factor Valuation of Treasury Bond Futures with an Embedded Quality Option”, Mainz, Outubro 2003.
20. International Economic Association World Congress, “Multi-Factor Valuation of Floating Range Notes”, Lisboa, Setembro 2002.
21. Portuguese Finance Network Conference, “Valuation of Interest Rate Path Dependent Options under Multi-Factor Gaussian HJM Models”, Évora, Junho 2002.
22. Quantitative Methods in Finance Conference, “Valuation of Interest Rate Path Dependent Options under Multi-Factor Gaussian HJM Models”, Sydney, Dezembro 2001.

23. Math Week 2001 Europe Conference, “Valuation of Interest Rate Path Dependent Options under Multi-Factor Gaussian HJM Models”, London, Novembro 2001.
24. European Finance Association Conference, “Kalman Filtering of Gaussian Exponential-Affine LIBOR-Rate Models Using Caps and Swaptions”, Helsinki, Agosto 1999.
25. Financial Options Research Center Conference, “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: An Arrow-Debreu Pricing Approach”, Warwick, Julho 1999.
26. Derivatives Securities Conference, “Kalman Filtering of Gaussian Exponential-Affine LIBOR-Rate Models Using Caps and Swaptions”, Boston, Abril 1999.
27. Quantitative Methods in Finance Conference, “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: Application of Green’s Functions”, Sydney, Dezembro 1998.
28. Southern Finance Association Conference, “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: Application of Green’s Functions”, Florida, Novembro 1998.
29. European Finance Association Conference, “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: Application of Green’s Functions”, Fontainebleau, Agosto 1998.
30. French Financial Association Conference, “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: Application of Green’s Functions”, Lille, Julho 1998.
31. European Financial Management Association Conference, “Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: Application of Green’s Functions”, Lisboa, Junho 1998.
32. French Financial Association Conference, “Interest Rate Options in a Duffie-Kan Model with Deterministic Volatility”, Grenoble, Junho 1997.

5.1.4. Discussões de artigos científicos em conferências com referees

1. Discussão do artigo “Corporate Bond Risk Premia”, do autor Christian Speck, na FMA Europe 2013 Meeting, Luxembourg, June 2013.
2. Discussão do artigo “On Recovery and Intensity’s Correlation: A New Class of Credit Risk Models”, dos autores R. Gaspar e I. Slinko, na Portuguese Finance Network Conference, Coimbra, Julho 2008.
3. Discussão do artigo “Option Pricing under Stochastic Volatility and Trading Volume”, do autor Ono Sadayuki, na EFMA Conference, Viena, Junho 2007.
4. Discussão do artigo “Optimal Debt, Asset Substitution and Coupon Rating-Trigger Covenants”, dos autores J. Azevedo Pereira e S. Silva, na Lisbon-Sloan Seminar Series in Management, Lisboa, Maio 2007.
5. Discussão do artigo “Pricing Credit Risk as ParAsian Options with Endogenous Recovery Rate of Corporate Bonds”, dos autores L. Yu, D. Newton, P. Duck, M. Widdicks e P. Johnson, na Portuguese Finance Network Conference, Lisboa, Julho 2004.
6. Discussão do artigo “Correlation Risk Premia for Multi-Asset Equity Options”, dos autores M. Fengler e P. Schwendnerz, na German Finance Association (DGF) Conference, Mainz, Outubro 2003.
7. Discussão do artigo “On the Market Model of Futures Rates”, dos autores K. Sandmann e J. Nielsen, na Conferência do CEMAF/ISCTE, Lisboa, Março 2001.
8. Discussão do artigo “A Model for Pricing an Option with a Fuzzy Payoff”, dos autores S. Muzzioli e C. Torricelli, na Portuguese Finance Network Conference, Braga, Agosto 2000.
9. Discussão do artigo “The Relative Valuation of Caps and Swaptions: Theory and Empirical Evidence”, dos autores F. Longstaff, P. Santa-Clara e E. Schwartz, na Portuguese Finance Network Conference, Braga, Agosto 2000.

10. Discussão do artigo “Fair Valuation of Life Insurance Liabilities: The Impact of Interest Rate Guarantees, Surrender Options, and Bonus Policies”, dos autores A. Großen e P. Jørgensen, na European Finance Association Conference, Fontainebleau, Agosto 1998.
11. Discussão do artigo “Asian Options, the Sum of Lognormals and the Reciprocal Gamma Distribution”, dos autores M. Milevsky e S. Posner, na European Financial Management Association Conference, Lisboa, Junho 1998.

5.1.5. Organização de eventos científicos

1. Organização da Conferência Internacional de Finanças da ISCTE-IUL Business School no ano de 2001.
2. Participação como “instructor” no EFMA 2012 Doctorate Seminar, Barcelona 2012.

5.2. Projectos científicos

1. Coordenador do projecto PTDC/EGE-ECO/099255/2008 com o título “Early exercise decisions under uncertainty and stochastic interest rates” e aprovado pela Fundação de Ciência e Tecnologia (FCT). Valor total do projecto financiado pela FCT: 159,178.00 EUR. Duração do projecto: de Janeiro de 2010 a Dezembro de 2012.

5.3. Coordenação e liderança científica

1. Membro da comissão científica do departamento de Finanças do ISCTE-IUL desde 2007.
2. Membro da comissão científica da ISCTE-IUL Business School desde 2007.
3. Membro da comissão coordenadora da comissão científica do ISCTE de 2007 a 2009.
4. Membro eleito do conselho científico do ISCTE – IUL desde 2009.
5. Membro da Comissão Científica da Portuguese Finance Network desde 2008.

6. Colaborador do CMAF – Centro de Matemática e Aplicações Fundamentais da Universidade de Lisboa desde 2007.
7. Director do Finance Research Center (FRC) do ISCTE-IUL de 2007 a 2008.
8. Director do CEMAF/ISCTE (Centro de Investigação em Mercados e Activos Financeiros) de 2005 a 2007.

5.4. Avaliação científica

5.4.1. Participação no júri de graus académicos

Júris de doutoramento

1. Membro do júri, em Julho de 2014, da tese de doutoramento elaborada por Paulo Viegas de Carvalho com vista à obtenção do grau de doutor em Finanças pelo ISCTE-IUL e intitulada “Essays on Credit Rating Announcements”. Orientadore: Profs. João Pedro Pereira.
2. Arguência, em Março de 2014 e na Universidade de Évora, da tese de doutoramento elaborada por Maria Manuela Coelho Larginho e intitulada “Essays on Option Pricing under Alternative One-Dimensional Diffusions”. Orientadores: Profs. Carlos Alberto dos Santos Braumann e José Carlos Gonçalves Dias.
3. Arguência, em Dezembro de 2013 e na Universidade Nova de Lisboa, da tese de doutoramento elaborada por João Beleza Teixeira Seixas e Sousa e intitulada “Machine Learning Gaussian Short Rate”. Orientadores: Prof. Manuel Esquível e Prof^a. Raquel Gaspar.
4. Membro do júri, em Junho de 2013, da tese de doutoramento elaborada por Joaquim António Martins Ferrão com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE-IUL e intitulada “Low Leverage Policy: Factors that may Influence Debt-Equity Choices”. Orientadores: Profs. José Dias Curto e José Paulo Esperança.

5. Membro do júri, em Setembro de 2011, da tese de doutoramento elaborada por Paulo José Araújo dos Santos com vista à obtenção do grau de doutor em Estatística e Investigação Operacional pela FCUL e intitulada “Excesses, Durations and Forecasting Value-at-Risk”. Orientador: Prof^a. Maria Isabel Fraga Alves.
6. Arguência, em Julho de 2010 e na Universidade de Évora, da tese de doutoramento elaborada por Maria Clara Pereira Pires e intitulada “Acordo de Basileia II: Análise da Adequação do Rácio Mínimo de Solvabilidade à Realidade do Sector Bancário Português”. Orientador: Prof^a. Isabel Viegas Vieira.
7. Membro do júri, em Maio de 2010, da tese de doutoramento elaborada por Carlos Pedro dos Santos Gonçalves com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE-IUL e intitulada “Contributos para os Fundamentos Categoriais da Matemática do Risco”. Orientador: Prof. José Dias Curto.
8. Membro do júri, em Julho de 2009, da tese de doutoramento elaborada por Samuel José da Rocha Lopes com vista à obtenção do grau de doutor em Finanças pelo ISCTE e intitulada “Essays on Credit Risk Management for Firms”. Orientador: Prof. Mohamed Azzim.
9. Arguência, em Julho de 2008 e no ISEG, da tese de doutoramento elaborada por Sérgio Ferreira da Silva e intitulada “Essays on Corporate Debt”. Orientador: Prof. José Azevedo Pereira.
10. Membro do júri, em Janeiro de 2008, da tese de doutoramento elaborada por Luís Pedro Krug Pacheco com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE e intitulada “Essays on Initial Stock Repurchases”. Orientador: Prof^a. Clara Raposo.
11. Membro do júri, em Janeiro de 2008, da tese de doutoramento elaborada por Paulo Fernando Garcia Alves com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE e intitulada “Essays on International Capital Markets”. Orientador: Prof. Miguel Almeida Ferreira.

12. Membro do júri, em Dezembro de 2007, da tese de doutoramento elaborada por Ana Cristina Brandão Fernandes com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE e intitulada “The Bid-Ask Spread Components: An Empirical Application to the London Stock Exchange”. Orientador: Prof. António Gomes Mota.
13. Membro do júri, em Setembro de 2006, da tese de doutoramento elaborada por José Carlos Gonçalves Dias com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE e intitulada “Essays in Real Options Models under Interest Rate Uncertainty”. Orientador: Profs. José Paulo Esperança e Mark Shackleton.
14. Membro do júri, em Setembro de 2000, da tese de doutoramento elaborada por Anna Vong Pou Iu com vista à obtenção do grau de doutor em Gestão pelo ISCTE e intitulada “Underpricing in Initial Public Offerings: A Novel Theoretical Framework and Empirical Methodology”. Orientador: Prof. Duarte Trigueiros.

Júris de mestrado

1. Membro do júri, em Junho de 2014 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Carolina Albardeiro Santana e intitulada “Modelos de Risco de Crédito: Análise de Telecoms Europeias e Bancos Americanos”. Orientador: Prof. José Carlos Dias.
2. Membro do júri, em Dezembro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Liliana Ramos Estrela Santa Miguel e intitulada “Basileia III no Sistema Bancário Português”. Orientador: Dr. Fernando Infante.
3. Membro do júri, em Dezembro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Ana Sofia Rodrigues Matos e intitulada “Evaluation of EGF: A privatization case”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
4. Membro do júri, em Dezembro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Mário António Limede e intitulada “Modelos de Avaliação de Risco de Crédito - Análise e Aplicação”. Orientador: Prof. José Carlos Dias.

5. Arguência, em Outubro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Ana Rita Mota e intitulada “Na busca de uma nova estrutura de regulação e supervisão financeira em Portugal na sequência da crise financeira de 2008-2013”. Orientador: Prof. Luís Vilela Pimentel.
6. Arguência, em Julho de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Rui Elias de Faria e intitulada “Optimização de Riscos Financeiros em Fundos de Pensões”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
7. Membro do júri, em Junho de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Rita Alexandra Tiago Rebelo e intitulada “Equity Research: Group Inditex”. Orientador: Prof. Clara Raposo.
8. Membro do júri, em Junho de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Gonçalo Marco Correia Plácido e intitulada “O Investimento em Infraestruturas de Transportes: Doutrina e Casos”. Orientador: Prof. Rui Alpalhão.
9. Membro do júri, em Janeiro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Rosa Maria Silva Ferreira e intitulada “Business Plan da Unidade de Negócio Salto Quântico”. Orientador: Eng. João Themudo Caldeira Cabral.
10. Arguência, em Janeiro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Victor Massena Batista e intitulada “A Gestão de Risco de Mercado no Contexto Solvência II”. Orientador: Dr. Luís Malcato.
11. Arguência, em Janeiro de 2013 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por João Heitor Canas e intitulada “A Imunização do Risco de Taxa de Juro: Um Ensaio com Obrigações do Tesouro Português”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
12. Arguência, em Junho de 2012 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Liliana Brandão Jerónimo e intitulada “All that Glitters is not Gold: Diversification Strategies in Reserve Portfolio Management”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
13. Membro do júri, em Junho de 2012 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Cláudia Sofia Gouveia Fonseca e intitulada “Gestão Activa Versus Gestão Passiva:

Análise Comparativa da Performance dos Exchange Traded Funds”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.

14. Membro do júri, em Junho de 2012 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Ana Cristina Osório de Sousa Ferreira e intitulada “Parcerias Público-Privadas no Sector Rodoviário”. Orientador: Dr^a. Ana Sá Ribeiro.
15. Membro do júri, em Janeiro de 2012 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Rui Manuel dos Santos Gomes e intitulada “Obrigações Hipotecárias versus RMBS”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.
16. Membro do júri, em Julho de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Ricardo José Duque Lopes e intitulada “Os Riscos da Mediação de Seguros para os Seguradores: A perspectiva do regime solvência II”. Orientador: Dr. Luís Malcato.
17. Membro do júri, em Julho de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Sara Mileta e intitulada “The Role of PE/VC Investment with Private Offering in the Development of Financial Market and the Economy in the Republic of Croatia”. Orientador: Prof^a. Helena Pinto de Sousa.
18. Membro do júri, em Junho de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Miguel Carlos Bettencourt Sardinha Levy Aires e intitulada “Air Tours: Um projecto de turismo aéreo com base no rio Tejo”. Orientador: Prof. Carlos Gonçalves.
19. Membro do júri, em Junho de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Carla Alexandra Botas Prates e intitulada “Pricing and Hedging Volatility Options”. Orientador: Prof. José Carlos Dias.
20. Membro do júri, em Junho de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Tiago Miguel Teixeira Carrazedo e intitulada “The Halloween Effect in European Sectors”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
21. Membro do júri, em Junho de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Bernhard Waldmüller e intitulada “Analysis of the Market for Insurance-Linked-Securities”. Orientador: Prof^a. Sofia Ramos.

22. Membro do júri, em Janeiro de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Ricardo Jorge Ribeiro Batista e intitulada “Determinantes do Spread Relativo ao Crédito Bancário em Portugal”. Orientador: Prof. João Pedro Pereira.
23. Membro do júri, em Janeiro de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Jorge Manuel Duque de Oliveira e intitulada “Pricing Corporate Debt and Credit Risk Under the CEV Model”. Orientador: Prof. José Carlos Dias.
24. Membro do júri, em Janeiro de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Cláudia Pereira Correia e intitulada “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 de dívida pública emitida por países de mercados emergentes”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
25. Membro do júri, em Janeiro de 2011 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Pedro Jorge Reis Pinto e intitulada “Galp Energia: Uma Empresa Alavancada à Bacia de Santos. Avaliação económica-financeira do projecto do Tupi”. Orientador: Prof^a. Clara Raposo.
26. Membro do júri, em Junho de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Bruno Miguel dos Santos Teixeira e intitulada “O Impacto da Nova Regulação Europeia na Indústria de Hedge Funds”. Orientador: Prof. João Pedro Pereira.
27. Membro do júri, em Junho de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Cátia Sofia Cerqueira Lopes e intitulada “A Reintermediação Financeira como Driver da Sustentabilidade do Sistema Financeiro Português”. Orientador: Prof. João Pedro Pereira.
28. Membro do júri, em Junho de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Francisco José Garcia dos Santos e intitulada “Percepção dos Risco por Investidores de Fundos de Investimento”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.

29. Membro do júri, em Junho de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Paulo José Morgado Lopes Gomes e intitulada “A Titularização de Créditos como Meio de Financiamento”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
30. Membro do júri, em Junho de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Pedro Jorge do Carmo Francisco Morgado Fernandes e intitulada “Upaje - Desafios para o Futuro”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.
31. Membro do júri, em Abril de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por João Pedro Bento Ruas e intitulada “Market Neutral Volatility: A Different Approach to the S&P 500 Options Market Efficiency”. Orientador: Prof. José Dias Curto.
32. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Paulo José Morgado Lopes Gomes e intitulada “A Utilização de Instrumentos Financeiros Derivados em Empresas não Financeiras: O caso EDP - Energias de Portugal, S.A”. Orientador: Prof. João Abrantes Costa.
33. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Gonçalo Moura Alves Dinis e intitulada “A Transferência de Risco de Seguros para o Mercado de Capitais”. Orientador: Prof. João Pedro Pereira.
34. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Nuno Miguel Martins Pliças Caetano e intitulada “Análise da Viabilidade Económica-Financeira de uma Unidade de Resíduos Industriais não Perigosos em Portugal”. Orientador: Prof. José Paulo Esperança.
35. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Nuno Alexandre da Graça Tomás e intitulada “Investimento Imobiliário no Brasil”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.
36. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Nuno Alexandre da Graça Tomás e intitulada “O Efeito de Contágio (Spill-Over) entre os Mercados Bolsistas”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.

37. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Sandra Maria Poço Ramos e intitulada “Definição Estratégica para uma Empresa na Indústria dos Vinhos em Portugal. Case Study José Maria da Fonseca”. Orientador: Prof. José Crespo de Carvalho.
38. Membro do júri, em Janeiro de 2010 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Joana Paula Salvador e intitulada “Inflation-Linked Bonds: Comparação com Treasuries e Alocação na Fronteira Eficiente”. Orientador: Prof^a. Sofia Ramos.
39. Membro do júri, em Dezembro de 2009 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Joaquim José Miranda Sarmiento e intitulada “Does Public Private Partnerships Create Value for Money to the Public Sector? A Financial Analysis Using the Portuguese Experience”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.
40. Membro do júri, em Dezembro de 2009 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Silvério dos Santos e intitulada “Insolvência e Recuperação de Empresas: O relatório do administrador da insolvência”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.
41. Membro do júri, em Dezembro de 2009 e no ISCTE-IUL, da tese de mestrado elaborada por Filipa Isabel Oliveira Marques e intitulada “Dificuldades Financeiras”. Orientador: Prof. Paulo Bento.
42. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por João André da Silva Seatra e intitulada “Avaliação da Tomada Firme de Seis Emissões de Direitos no Canada”. Orientador: Prof. Fernando Anjos.
43. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Darina Ivantchova Todorova de Matos e intitulada “Avaliação da Performance de Modelos de Value-at-Risk em Mercados Emergentes”. Orientador: Prof. João Pedro Pereira.
44. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Marta Rodrigues da Silva Martins de Paula e intitulada “Impacto da Crise Sub-Prime no Sector Bancário Português”. Orientador: Prof. Luís Oliveira.

45. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Paulo Miguel Nunes de Almeida e intitulada “Avaliação de Empresas nos Mercados Emergentes - Sociedade Mineira de CATOCA”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.
46. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Ricardo Emanuel Sarmiento Correia e intitulada “Testing Information Efficiency in the Portuguese Stock Market”. Orientador: Prof. Pedro Leite Inácio.
47. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Bernardo Maria Lebre Franco Lacerda e intitulada “Sistemas Alternativos de Negociação - O Caso Europeu”. Orientador: Prof^a. Sofia Brito Ramos.
48. Membro do júri, em Julho de 2009 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Sofia Raquel Pestana de Carvalho e intitulada “Mercados de Derivados - Weather Derivatives”. Orientador: Prof^a. Sofia Brito Ramos.
49. Arguência, em Março de 2009 e no ISEG, da tese de mestrado elaborada por Vítor Manuel Branco Oliveira e intitulada “Comparação entre Gestão Activa e Gestão Passiva de um Portfolio de Acções: um Estudo Empírico com Base no PSI20”. Orientador: Prof. Eduardo Couto.
50. Arguência, em Novembro de 2008 e no ISEG, da tese de mestrado elaborada por Ana Cristina Castanheira Carvalho Fonseca e intitulada “Recovery Rate in Credit Derivatives Markets”. Orientadora: Prof^a. Raquel Gaspar.
51. Membro do júri, em Janeiro de 2008 e no ISCTE, da tese de mestrado elaborada por Filipa Martins Tavares e intitulada “Capital Requirements and Potential Future Exposure Comparison on a Portfolio of Interest Rate Swaps”. Orientador: Prof. João Pedro Pereira.
52. Arguência, em Junho de 2007 e no ISEG, da tese de mestrado elaborada por Ricardo Figueiredo Belchior e intitulada “Acknowledging the Value of Creating Real Options – Empirical Evidence from the Telecommunications Industry”. Orientadora: Prof^a. Maria Helena Ferreira Pinto.

53. Arguência, em Março de 2004 e na Universidade Nova de Lisboa, da tese de mestrado elaborada por Carlos Manuel Antunes Veiga e intitulada “Expandindo o Universo de Opções Exóticas Avaliadas com uma Fórmula Fechada”. Orientador: Prof. Manuel Esquível.
54. Arguência, em Abril de 2003 e no ISEG, da tese de mestrado elaborada por Maria Clara Pereira Pires e intitulada “Supervisão Bancária - O caso particular do risco de taxa de juro”. Orientador: Prof. Carlos Pereira da Silva.
55. Arguência, em Julho de 2002 e na Universidade do Minho, da tese de mestrado elaborada por Ricardo Gomes Pereira e intitulada “Investimentos Interrelacionados no Contexto das Opções Reais: Discussão e Aplicação de um Modelo Genérico de Avaliação de Projectos de Investimento a um Caso de Fusões e Aquisições”. Orientador: Prof. Manuel Rocha Armada.
56. Arguência, em Fevereiro de 2002 e no ISEG, da tese de mestrado elaborada por Jorge Ventura Bravo e intitulada “Modelos de Risco de Taxa de Juro: Estratégias de Cobertura e Imunização”. Orientador: Prof. Carlos Pereira da Silva.
57. Arguência, em Abril de 2001 e no ISEG, da tese de mestrado elaborada por Daniel Fonseca dos Reis e intitulada “Fundos de Pensões de Contribuição Definida Incorporando um Princípio de Benefício Definido”. Orientador: Prof. Carlos Pereira da Silva.

5.4.2. Provas de agregação

1. Provas de agregação em Finanças do Professor João Pedro Pereira, ISCTE-IUL, Novembro de 2013.
2. Provas de agregação em Contabilidade da Professora Helena de Oliveira Isidro, ISCTE-IUL, Julho de 2014.

5.4.3. Refereeing em jornais académicos internacionais

Jornais académicos onde tenho efectuado a revisão científica de artigos:

1. Applied Numerical Mathematics
2. Asia Pacific Management Review
3. Brazilian Review of Econometrics
4. Computer Physics Communications
5. European Central Bank
6. European Financial Management
7. Journal of Banking and Finance
8. Journal of Business Finance and Accounting
9. Journal of Economic Dynamics and Control
10. Journal Futures Markets
11. Journal of Modelling in Management
12. Journal of Risk Model Validation
13. Physica A
14. Portuguese Journal of Management Studies
15. Quantitative Finance
16. Sociedade Portuguesa de Estatística
17. Risk

6. Extensão universitária

6.1. Acções de formação para empresas

1. EDP, 2005, “Programa de Formação em Financial Risk Management”.
2. Caixa Geral de Depósitos, 2004, “Curso Avançado de Gestão do Risco de Mercado”.
3. Instituto de Seguros de Portugal, 2002 (1ª edição) e 2005 (2ª edição), “Programa de Formação em Mercados Financeiros, Instrumentos e Técnicas de Inovação Financeira”.
4. PME-Investimentos, 1999, “Programa Avançado em Avaliação de Activos Financeiros e Corporate Finance”.
5. Banco Comercial dos Açores, 1996, “Programa de Formação em Derivados Financeiros”.

6.2. Actividades de consultoria

1. IGFCSS – Instituto de Gestão de Fundos de Capitalização da Segurança Social (1999-2010): Relatório trimestral de avaliação de performance da carteira de activos.
2. SGFPBP – Sociedade Gestora de Fundos de Pensões do Banco de Portugal (2000-2006): Desenvolvimento de software de gestão de riscos financeiros.
3. BDO (2008-2009): Avaliação de produtos estruturados.
4. NOVABASE (2010): Avaliação de produtos estruturados.

7. Serviço à instituição

1. Funções desempenhadas e projectos de desenvolvimento universitário:
 - (a) Membro eleito do Conselho Científico do ISCTE-IUL desde 2010.

- (b) Membro do Senado do ISCTE-IUL de 2010 a 2013.
 - (c) Membro eleito do Conselho Geral do ISCTE-IUL de 2009 a 2013.
 - (d) Membro da Direcção do INDEG/ISCTE, em representação do ISCTE, de 2007 a 2013.
 - (e) Responsável pela selecção dos candidatos de todos os mestrados executivos da área de Finanças do INDEG/ISCTE, de 2007 a 2013.
 - (f) Co-responsável pela selecção dos candidatos ao mestrado em Matemática Financeira da ISCTE-IUL Business School e da FCUL desde 2005.
 - (g) Responsável pela selecção dos candidatos à área de Finanças do Programa Doutoral em Gestão do ISCTE entre 2001 e 2005.
2. Co-fundador (em 1995), Director (desde 1995), Vice-Presidente (de 2000 a 2005), e Presidente (de 2005 a 2007) do CEMAF - Centro de Investigação de Mercados e Activos Financeiros do ISCTE. Esta associação desempenhou um papel inovador na formação pós-graduada em Portugal ao desenvolver um portfolio único de programas de pós-graduação especializados na área de finanças e no apoio à actividade de investigação (concessão de apoios a doutoramentos no exterior, realização de conferências científicas e publicação da Revista de Mercados e Activos Financeiros, depois Portuguese Finance Review).

Tabela 2: Desempenho pedagógico nas licenciaturas

Licenciatura	Unidade curricular	Ano lectivo	Turma	Capacidades		Escala
				pedagógica	científica	
Finanças	Investimentos	2001/02	FB1	4.64	4.84	1-5
Finanças	Investimentos	2001/02	FB2	4.71	4.82	1-5
Finanças	Investimentos	2003/04	FB1	9.3	9.7	1-10
Finanças	Investimentos	2003/04	FB2	9	9.4	1-10
OGE	Gestão Financeira I	2003/04	GCi	ND	9.9	1-10
Finanças	Investimentos	2004/05	FB1	9.3	9.6	1-10
Finanças	Investimentos	2004/05	FB2	9.2	9.7	1-10
OGE	Gestão Financeira I	2004/05	GCi	ND	9.6	1-10
OGE	Gestão Financeira I	2005/06	GC1	9.2	9.4	1-10
Gestão	Investimentos	2007/08	Gci	8.73		1-10
Gestão	Investimentos	2008/09	Gci	8.51		1-10
Finanças	Investimentos	2009/10	FB1 e 2	8.81		1-10
Gestão	Investimentos	2009/10	Gci	8.86		1-10
Finanças	Investimentos	2010/11	FB1 e 2	9		1-10

ND = item não disponível

Tabela 3: Desempenho pedagógico nos mestrados

Mestrado	Unidade	Ano	Capacidades		Escala
	curricular		lectivo	pedagógica	
Finanças	Investimentos Fin.	2002/03	4.63	4.89	1-5
Finanças	Compl. de Opções	2002/03	4.94	4.94	1-5
Finanças	Investimentos Fin.	2003/04	4.58	4.92	1-5
Finanças	Compl. de Opções	2003/04	4.77	4.85	1-5
Finanças	Opções Financeiras	2004/05	4.5	4.93	1-5
Finanças	Opções Financeiras	2005/06	4.34	4.59	1-5
Finanças	Compl. de Opções	2005/06	4.33	4.78	1-5
MatFin	Opções Exóticas	2005/06	4.23	4.86	1-5
MatFin	Opções Exóticas	2007/08	4.8	5	1-5
MatFin	Modelos ETTJ	2007/08	4.9	4.9	1-5
MatFin	Modelos ETTJ	2008/09	4.85	5	1-5
Finanças	Opções Financeiras	2009/10	4.4	4.8	1-5
MatFin	Opções Exóticas	2009/10	5	5	1-5
MatFin	Modelos ETTJ	2009/10	4.9	5	1-5
MatFin	Opções Exóticas	2010/11	4.8	5	1-5
MatFin	Modelos ETTJ	2010/11	4.8	5	1-5

Tabela 4: Desempenho pedagógico nas pós-graduações

Pós- Graduação	Unidade curricular	Ano lectivo	Turma	Capacidades		Escala
				pedagógica	científica	
MAF	Gestão Activos P.	2002/03		4.5	4.9	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2003/04		4.7	5	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2003/04		4.8	4.8	1-5
CF	Opções	2003/04		4.3	4.8	1-5
GIF	Opções	2003/04		4.1	4.7	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2004/05		4.4	4.9	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2004/05		4.4	4.8	1-5
CF	Opções	2004/05		4.2	4.6	1-5
GIF	Opções	2004/05		4.2	4.6	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2005/06		4.3	4.6	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2005/06		4.7	4.8	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2006/07		4.8	4.9	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2006/07		4.8	4.9	1-5
CF	A. Taxa de Juro	2007/08		4.7	4.9	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2007/08		4.6	5	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2007/08		4.4	4.8	1-5

(continua)

Tabela 4—*continuação*

Pós- Graduação	Unidade curricular	Ano lectivo	Turma	Capacidades		Escala
				pedagógica	científica	
MAF	Gestão Activos P.	2008/09		4.8	5	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2008/09		4.8	4.9	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2009/10		4.6	4.8	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2009/10		4.9	5	1-5
MAF	Gestão Activos P.	2010/11		4.4	4.8	1-5
MAF	Produtos Estruturados	2010/11		4.2	4.9	1-5