

**Aviso:** [2024-07-22 10:04] 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.

## Aricson da Cruz

### Investigador Integrado

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)  
[Grupo de Finanças]

### Contactos

#### E-mail

Aricson\_Cruz@iscte-iul.pt

### Total de Citações

#### Web of Science®

14

#### Scopus

12

### Publicações

#### • Revistas Científicas

##### - Artigo em revista científica

1	Glória, C. M., Dias, J. C. & Cruz, A. (2024). Pricing levered warrants under the CEV diffusion model. Review of Derivatives Research. 27 (1), 55-84
2	Cruz, A. & Dias, J. C. (2020). Valuing American-style options under the CEV model: an integral representation based method. Review of Derivatives Research. 23 (1), 63-83 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 6

3	<p>Dias, J. C., Nunes, J. &amp; Cruz, A. (2020). A note on options and bubbles under the CEV model: Implications for pricing and hedging. <i>Review of Derivatives Research</i>. 23 (3), 249-272</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 5</li> <li>- N.º de citações Scopus: 4</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 10</li> </ul>
4	<p>Cruz, A. &amp; Dias, J. C. (2017). The binomial CEV model and the Greeks. <i>Journal of Futures Markets</i>. 37 (1), 90-104</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 6</li> <li>- N.º de citações Scopus: 5</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 8</li> </ul>

## • Conferências/Workshops e Comunicações

### - Comunicação em evento científico

1	<p>Gloria, C. M., Dias, J. C. &amp; Cruz, A. (2021). Pricing Levered Warrants under the CEV Diffusion Model. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.</p>
---	---