Aviso: [2024-04-23 17:33] 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®	13
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	Dias, J. C., Nunes, J. & Cruz, A. (2020). A note on options and bubbles under the CEV model: Implications for pricing and hedging. Review of Derivatives Research. 23 (3), 249-272 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 10
4	Cruz, A. & Dias, J. C. (2017). The binomial CEV model and the Greeks. Journal of Futures Markets. 37 (1), 90-104 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 5 - N.º de citações Google Scholar: 8

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

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