INSTITUTO UNIVERSITÁRIO DE LISBOA

Ciência_Iscte

Perfil Público

Aviso: [2026-11-22 12:47] este documento é uma impressão do portal Ciência_Iscte e foi gerado na data indicada. O documento tem um propósito meramente informativo e representa a informação contida no portal Ciência_Iscte nessa data.

Aricson da Cruz

Membro Afiliado
BRU-Iscte - Business Research Unit

Contactos

E-mail	Aricson_Cruz@iscte-iul.pt

Total de Citações

Web of Science®	27
Scopus	25

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. https://doi.org/10.1007/s11147-023-09199-1 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 8

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. https://doi.org/10.1007/s11147-019-09157-w - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 11
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. https://doi.org/10.1007/s11147-019-09164-x - N.º de citações Web of Science®: 10 - N.º de citações Scopus: 8 - N.º de citações Google Scholar: 14
4	Cruz, A. & Dias, J. C. (2017). The binomial CEV model and the Greeks. Journal of Futures Markets, 37(1), 90?104. https://doi.org/10.1002/fut.21791 - N.º de citações Web of Science®: 7 - 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,.