

Aviso: [2026-05-24 14:21] 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®

26

Scopus

22

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

- | | |
|---|---|
| 1 | <p>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</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 8 |
|---|---|

2	<p>Cruz, A. & Dias, J. C. (2020). Valuing American-style options under the CEV model: an integral representation based method. <i>Review of Derivatives Research</i>. 23 (1), 63-83</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 11
3	<p>Dias, J. C., Nunes, J. & 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"> - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 7 - N.º de citações Google Scholar: 15
4	<p>Cruz, A. & 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"> - 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	<p>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.</p>
---	---