Aviso: [2026-10-30 17:18] 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.

Fernando Silva

Investigador Integrado
BRU-Iscte - Business Research Unit



Contactos

E-mail	fcsaa@iscte-iul.pt
Gabinete	D5.12

Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
ISCTE Business School	Doutoramento	Finanças	2023
ISCTE Business School e Faculdade de Ciências	Mestrado	Matemática Financeira	2018
Universidade de Lisboa - Faculdade de Ciencias	Licenciatura	Matemática	1991

Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord.
2026/2027	2º	Investimentos I	Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças;	Sim

2025/2026	2º	Investimentos I	Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças;	Não

Orientações

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Adriana Costa Ventura	Avaliação de opções spread	Português	Entregue	Iscte
2	Joana Filipa Silva Assunção	Option pricing models with skewness and kurtosis.	--	Em curso	Iscte

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Sandro Marcos Fernandes Gaspar	A abordagem de Kristensen e Mele (2011) para a aproximação de preços de derivados em modelos de tempo contínuo.	Inglês	Iscte	2025
2	Francisco Marcos Gonçalves Correia de Andrade Teixeira	A Abordagem da Fundamental Transform de Lewis para Pricing de Opções	Inglês	Iscte	2025
3	João de Almeida Martins	"Caps" e "Floors" de maturidade finita para opções de troca em "flows" contínuos.	Inglês	Iscte	2024
4	Rita Sofia Marques Pedro	Caps e Floors perpétuos sobre fluxos contínuos: Aplicações sobre taxas de juros	Português	Iscte	2024

Total de Citações

Web of Science®	9
Scopus	7

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Dias, J. C., Nunes, J. P. V., Ruas, J. P. & Silva, F. C. da. (2026). Optimal investment decisions with minimum price guarantees under the constant elasticity of variance process. Omega, 143. https://doi.org/10.1016/j.omega.2026.103556
2	Dias, J. C., Shackleton, M. B., Correia da Silva, F. & Wojakowski, R. M. (2026). Time integrals under the Black–Scholes–Merton and Margrabe economies. Journal of Futures Markets, 46(7), 1256?1274. https://doi.org/10.1002/fut.70107
3	Dias, J. C., Nunes, J. P. V. & Silva, F. (2024). Novel analytic representations for caps, floors, collars, and exchange options on continuous flows, arbitrage-free relations, and optimal investments. Journal of Futures Markets, 44(12), 1869?1887. https://doi.org/10.1002/fut.22549 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 2 - N.º de citações Google Scholar: 4
4	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. (2024). Finite maturity caps and floors on continuous flows under the constant elasticity of variance process. European Journal of Operational Research, 316(1), 361?385. https://doi.org/10.1016/j.ejor.2024.01.039 - N.º de citações Web of Science®: 7 - N.º de citações Scopus: 5 - N.º de citações Google Scholar: 10

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

1	Dias, J. C., Martins, J. & Silva, F. (2025). Finite-Lived Caps and Floors on Continuous Exchange Flows and Inflation-Linked Feed-In Tariff Contracts. 28th International Conference on Real Options,.
2	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. (2024). Novel Analytic Representations for Caps, Floors and Collars on Continuous Flows, Arbitrage-Free Relations and Optimal Investments. 33rd European Financial Management Association (EFMA),.