

**Aviso:** [2026-04-24 03:55] 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

### Professor Auxiliar Convidado

BRU-Iscte - Business Research Unit  
Departamento de Finanças (IBS)



## Contactos

### E-mail

fcsaa@iscte-iul.pt

## 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 Ciências	Licenciatura	Matemática	1991

## Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord
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	Joana Filipa Silva Assunção	Option pricing models with skewness and kurtosis.	--	Em curso	Iscte
2	Adriana Costa Ventura	Valuation of spread options; Avaliação de opções spread	--	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 derivativos 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®	8
Scopus	5

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	Dias, J. C., Shackleton, M. B., Correia da Silva, F. & Wojakowski, R. M. (N/A). Time integrals under the Black-Scholes-Merton and Margrabe economies. Journal of Futures Markets. N/A
---	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

2	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. <i>Omega</i> . 143
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. <i>Journal of Futures Markets</i> . 44 (12), 1869-1887 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 3
4	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. (2024). Finite maturity caps and floors on continuous flows under the constant elasticity of variance process. <i>European Journal of Operational Research</i> . 316 (1), 361-385 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 7

### • 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).