

Aviso: [2024-12-22 02:25] 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.

João Pedro Bento Ruas

Professor Auxiliar

Departamento de Finanças (IBS)

Investigador Integrado

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)
[Grupo de Finanças]



Contactos

| | |
|-----------------|-------------------------|
| E-mail | Joao.Ruas@iscte-iul.pt |
| Gabinete | D5.37 |
| Telefone | 217903936 (Ext: 795121) |
| Cacifo | 300 |

Áreas de Investigação

Financial Derivatives

Qualificações Académicas

| Universidade/Instituição | Tipo | Curso | Período |
|---|--------------|----------|---------|
| ISCTE-IUL | Doutoramento | Finanças | 2013 |
| ISCTE-IUL | Mestrado | Finanças | 2010 |
| Faculdade Economia da Universidade Nova de Lisboa | Licenciatura | Economia | 2003 |

Atividades Profissionais Externas

| Período | Empregador | País | Descrição |
|-------------|-------------------|----------|---------------|
| 2013 - 2021 | Banco de Portugal | Portugal | Banco Central |

Atividades Letivas

| Ano Letivo | Sem. | Nome da Unidade Curricular | Curso(s) | Coord |
|------------|------|---|--|-------|
| 2024/2025 | 2º | Investimentos I | Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2024/2025 | 2º | Gestão de Activos e Passivos | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2024/2025 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Não |
| 2024/2025 | 1º | Introdução às Finanças Computacionais | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Projeto de Investigação em Finanças | | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Tese em Finanças | | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas; | Não |
| 2024/2025 | 1º | Derivados Financeiros | Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Tese em Finanças | Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2024/2025 | 1º | Futuros, Forwards e Swaps | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Investimentos I | Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Gestão de Activos e Passivos | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Não |
| 2023/2024 | 1º | Introdução às Finanças Computacionais | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2023/2024 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas; | Não |
| 2023/2024 | 1º | Investimento em Derivados, Commodities e Cambiais | Outro em Applied Online em Mercados Financeiros: Criação e Gestão de Portfolios; | Sim |

| | | | | |
|-----------|----|---------------------------------------|--|-----|
| 2023/2024 | 1º | Futuros, Forwards e Swaps | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Investimentos I | Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Gestão de Activos e Passivos | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Não |
| 2022/2023 | 1º | Introdução às Finanças Computacionais | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2022/2023 | 1º | Investimentos e Mercados Financeiros | Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas; | Não |
| 2022/2023 | 1º | Futuros, Forwards e Swaps | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Investimentos I | Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Gestão de Activos e Passivos | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Investimentos | Licenciatura em Gestão; | Não |
| 2021/2022 | 1º | Introdução às Finanças Computacionais | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2021/2022 | 1º | Investimentos | Licenciatura em Finanças e Contabilidade; | Não |
| 2021/2022 | 1º | Futuros, Forwards e Swaps | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Investimentos I | Doutoramento em Economia; Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Gestão de Activos e Passivos | | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Introdução às Finanças | Licenciatura em Economia; | Não |
| 2020/2021 | 2º | Produtos Financeiros Derivados | Mestrado em Economia Monetária e Financeira; | Sim |
| 2020/2021 | 1º | Introdução às Finanças Computacionais | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Produtos Financeiros Derivados | Mestrado em Economia Monetária e Financeira; | Sim |
| 2019/2020 | 1º | Introdução às Finanças Computacionais | Curso Institucional em Escola de Gestão; | Sim |

Orientações

- **Teses de Doutoramento**
- Em curso

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Estado | Instituição |
|---|--------------------------------|---|--------|----------|-------------|
| 1 | Carlos Miguel Aguiar da Glória | Essays on option pricing | Inglês | Em curso | ISCTE-IUL |
| 2 | João Diogo Barros Moura | Financial Options: Options Returns, Hedging Strategy and Static Hedge Portfolio | Inglês | Em curso | ISCTE-IUL |

• Dissertações de Mestrado

- Em curso

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Estado | Instituição |
|---|---|---|--------|----------|-------------|
| 1 | Rafael Carreiras Ré | Os momentos neutros em relação ao risco do S&P 500 | -- | Em curso | ISCTE-IUL |
| 2 | José Miguel Mateus Serejo Rocha das Neves | Risk-neutral distributions implied from stochastic volatility jump-diffusion models | -- | Em curso | ISCTE-IUL |
| 3 | Miguel Natal de Brito Boto | Distribuição de risco neutro implícita: mistura de distribuições t | -- | Em curso | ISCTE-IUL |
| 4 | Cláudio dos Santos Machado | Distribuição implícita de risco neutro: abordagem paramétrica | -- | Em curso | ISCTE-IUL |

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|---|---|--|-----------|-------------|------------------|
| 1 | Mafalda Amaro Caneira | a variância do prémio de risco | -- | ISCTE-IUL | 2024 |
| 2 | Duarte Miguel da Cunha Domingues Amador Marques | Comparação Empírica sobre as Opções do Índice S&P 500: Modelo Black-Scholes-Merton e Modelo Heston | Inglês | ISCTE-IUL | 2023 |
| 3 | Raquel Lopes Coutinho | Avaliação de opções através de métodos de machine learning | Português | ISCTE-IUL | 2023 |
| 4 | João Pedro Gonçalves Cordeiro da Silva | Estrutura Temporal de Opções do S&P 500 | Inglês | ISCTE-IUL | 2022 |
| 5 | Pedro Miguel Tomás Carvalho | O Puzzle do Prémio do VIX | Português | ISCTE-IUL | 2021 |

Total de Citações

| | |
|-----------------|----|
| Web of Science® | 77 |
| Scopus | 56 |

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

| | |
|---|--|
| 1 | Glória, C. M., Dias, J. C., Ruas, J. P. & Nunes, J. P. V. (2024). The interaction between equity-based compensation and debt in managerial risk choices. <i>Review of Derivatives Research</i> . 27 (3), 227-258 |
| 2 | Nunes, J. & Ruas, J. (2024). A note on the Gumbel convergence for the Lee and Mykland jump tests. <i>Finance Research Letters</i> . 59 - N.º de citações Scopus: 1 |
| 3 | Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2020). Early exercise boundaries for American-style knock-out options. <i>European Journal of Operational Research</i> . 285 (2), 753-766 - N.º de citações Web of Science®: 10 - N.º de citações Scopus: 8 - N.º de citações Google Scholar: 12 |
| 4 | Nunes, J. P. V., Dias, J. C. & Ruas, J. P. (2020). The early exercise boundary under the jump to default extended CEV model. <i>Applied Mathematics and Optimization</i> . 82 (1), 151-181 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 2 - N.º de citações Google Scholar: 5 |
| 5 | Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. & Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. <i>Journal of Derivatives</i> . 23 (4), 20-32 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 2 |
| 6 | Dias, J. C., Nunes, J. P. V. & Ruas, J. P. (2015). Pricing and static hedging of european-style double barrier options under the jump to default extended CEV model. <i>Quantitative Finance</i> . 15 (12), 1995-2010 - N.º de citações Web of Science®: 19 - N.º de citações Scopus: 13 - N.º de citações Google Scholar: 23 |
| 7 | Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2015). Pricing and static hedging of American-style knock-in options on defaultable stocks. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 58, 343-360 - N.º de citações Web of Science®: 19 - N.º de citações Scopus: 13 - N.º de citações Google Scholar: 23 |
| 8 | Ruas, J. P., Dias, J. C. & Nunes, J. (2013). Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 37 (11), 4059-4072 - N.º de citações Web of Science®: 27 - N.º de citações Scopus: 18 - N.º de citações Google Scholar: 34 |

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

| | |
|---|--|
| 1 | Glória, C. M., Dias, J. C. & Ruas, J. (2024). Robust Optimal Strategy for an AAM of DC Pension Plans under Jump-Diffusion and with Time-Varying Ambiguity. <i>Scandinavian Actuarial Conference 2024</i> . |
|---|--|

| | |
|---|--|
| 2 | Dias, J. C., Nunes, J., Ruas, J. & Silva, F. C. (2023). Optimal Investment Decisions with Minimum Price Guarantees under the Constant Elasticity of Variance Process. 26th International Conference on Real Options. |
| 3 | Dias, J. C., Nunes, J., Ruas, J. & Silva, F. C. (2023). Optimal Investment Decisions with Minimum Price Guarantees under the Constant Elasticity of Variance Process. 12th International Conference of the Portuguese Finance Network. |
| 4 | Gloria, C. M., Dias, J. C., Ruas, J. & Nunes, J. (2022). The Interaction Between Equity-Based Compensation and Debt in Managerial Risk Choices. Paris Financial Management Conference. |
| 5 | Dias, J. C., Ildefonso, J., Nunes, J. & Ruas, J. (2021). Repeated Richardson Extrapolation and Static Hedging of Barrier Options under the JDCEV Model. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network. |
| 6 | Ruas, J., Nunes, J. & Dias, J. C. (2018). Early Exercise Boundaries for American-style Knock-Out Options. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society. |
| 7 | Nunes, J., Dias, J. C. & Ruas, J. (2016). The Early Exercise Boundary under the Jump to Default Extended CEV Model. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society. |

• Outras Publicações

- Outras publicações

| | |
|---|---|
| 1 | Ruas, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Erratum to "Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model" (Journal of Banking and Finance (2013) 37(11) (4059–4072) (S0378426613002896) (10.1016/j.jbankfin.2013.07.019)). Journal of Banking and Finance. 81, 20-23 |
|---|---|

Cargos de Gestão Académica

Director (2024 - 2026)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças

Coordenador de ECTS (2024 - 2027)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Director (2022 - 2024)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças