Aviso: [2024-03-29 07:03] 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

Diretor
Departamento de Finanças (IBS)

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.
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 Finanças e Contabilidade; 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 (PL); Licenciatura em Informática e Gestão de Empresas;	Não
2023/2024	1º	Investimento em Derivados	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 Finanças e Contabilidade; 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 (PL); 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 Finanças e Contabilidade; 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; Licenciatura em Gestão;	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	Mestrado em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Introdução às Finanças	Licenciatura em Economia; Licenciatura em Gestão Industrial e Logística; Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão de Marketing; Licenciatura em Gestão;	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

- Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão

1	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
2	Raquel Lopes Coutinho	Avaliação de opções através de métodos de machine learning	Português	ISCTE-IUL	2023
3	João Pedro Gonçalves Cordeiro da Silva	Estrutura Temporal de Opções do S&P 500	Inglês	ISCTE-IUL	2022
4	Pedro Miguel Tomás Carvalho	O Puzzle do Prémio do VIX	Português	ISCTE-IUL	2021

Total de Citações

Web of Science®	61
Scopus	53

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

1	Nunes, J. & Ruas, J. (2024). A note on the Gumbel convergence for the Lee and Mykland jump tests. Finance Research Letters. 59
2	Nunes, J. P. V., Dias, J. C. & Ruas, J. P. (2020). The early exercise boundary under the jump to default extended CEV model. Applied Mathematics and Optimization. 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
3	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2020). Early exercise boundaries for American-style knock-out options. European Journal of Operational Research . 285 (2), 753-766 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 6 - N.º de citações Google Scholar: 11
4	Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. & Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. Journal of Derivatives. 23 (4), 20-32 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 1
5	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. Quantitative Finance. 15 (12), 1995-2010 - N.º de citações Web of Science®: 15 - N.º de citações Scopus: 13 - N.º de citações Google Scholar: 21

6	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2015). Pricing and static hedging of American-style knock-in options on defaultable stocks. Journal of Banking and Finance. 58, 343-360 - N.º de citações Web of Science®: 15 - N.º de citações Scopus: 13 - N.º de citações Google Scholar: 21
7	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. Journal of Banking and Finance. 37 (11), 4059-4072 - N.º de citações Web of Science®: 23 - N.º de citações Scopus: 18 - N.º de citações Google Scholar: 34

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

1	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.
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. 12th International Conference of the Portuguese Finance Network.
3	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.
4	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.
5	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.
6	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

Coordenador de ECTS (2024 - 2027) Unidade/Área: Departamento de Finanças
Director (2022 - 2024) Unidade/Área: [5563] Finanças