

**Aviso:** [2022-05-17 08:31] 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

<b>E-mail</b>	Joao.Ruas@iscte-iul.pt
<b>Gabinete</b>	D5.37
<b>Telefone</b>	217903936 (Ext: 795121)
<b>Cacifo</b>	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.
2021/2022	1º	Introdução às Finanças Computacionais	Escola de Gestão;	Sim
2021/2022	1º	Investimentos	Finanças e Contabilidade;	Não
2021/2022	1º	Futuros, Forwards e Swaps	Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Investimentos I	Economia; Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Gestão de Activos e Passivos	Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Investimentos	Gestão;	Não
2020/2021	1º	Introdução às Finanças Computacionais	Escola de Gestão;	Sim
2020/2021	2º	Investimentos I	Economia; Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Gestão de Activos e Passivos	Escola de Gestão;	Sim
2020/2021	2º	Introdução às Finanças	Finanças e Contabilidade; Gestão; Gestão Industrial e Logística; Gestão de Marketing; Economia;	Não
2020/2021	2º	Produtos Financeiros Derivados	Economia Monetária e Financeira;	Sim
2019/2020	1º	Introdução às Finanças Computacionais	Escola de Gestão;	Sim
2019/2020	2º	Produtos Financeiros Derivados	Economia Monetária e Financeira;	Sim

## Orientações

### • Teses de Doutoramento

- Em curso

Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
--------------------	-------------------	---------------	--------	--------	-------------

1	Orientador	João Diogo Barros Moura	Financial Options: Options Returns, Hedging Strategy and Static Hedge Portfolio	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL
---	------------	-------------------------	---	--------	----------	-----------

## • Dissertações de Mestrado

### - Em curso

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Orientador	Ana Rita Batalha Augusto	Contango nos Futuros do VIX	--	Em curso	ISCTE-IUL
2	Orientador	João Pedro Gonçalves Cordeiro da Silva	Estrutura Temporal de Opções sobre Futuros do S&P 500	--	Em curso	ISCTE-IUL

### - Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Orientador	Pedro Miguel Tomás Carvalho	O Puzzle do Prémio do VIX	Português	ISCTE-IUL	2021

## Total de Citações

<b>Web of Science®</b>	46
<b>Scopus</b>	43

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	<p>Nunes, J., Ruas, J. &amp; Dias, J. C. (2020). Early exercise boundaries for American-style knock-out options. <i>European Journal of Operational Research</i> . 285 (2), 753-766</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 5</li> <li>- N.º de citações Scopus: 4</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 8</li> </ul>
2	<p>Nunes, J. P. V., Dias, J. C. &amp; 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</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 1</li> <li>- N.º de citações Scopus: 2</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 5</li> </ul>

3	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 Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 1
4	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®: 11 - N.º de citações Scopus: 10 - N.º de citações Google Scholar: 16
5	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®: 12 - N.º de citações Scopus: 11 - N.º de citações Google Scholar: 17
6	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®: 17 - N.º de citações Scopus: 15 - N.º de citações Google Scholar: 28

## • Conferências/Workshops e Comunicações

### - Comunicação em evento científico

1	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.
2	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.
3	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" ( <i>Journal of Banking and Finance</i> (2013) 37(11) (4059–4072) (S0378426613002896) (10.1016/j.jbankfin.2013.07.019)). <i>Journal of Banking and Finance</i> . 81, 20-23
---	---

## Cargos de Gestão Académica

Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos e Passivos (2023)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Investimentos I (2023)  
Unidade/Área: Finanças

<p>Coordenador da unidade curricular Introdução às Finanças Computacionais (2022 - 2023) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Futuros, Forwards e Swaps (2022 - 2023) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Investimentos I (2022) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos e Passivos (2022) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Introdução às Finanças Computacionais (2021 - 2022) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Futuros, Forwards e Swaps (2021 - 2022) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão de Activos e Passivos (2021) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2021) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Investimentos I (2021) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Introdução às Finanças Computacionais (2020 - 2021) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2020) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Introdução às Finanças Computacionais (2019 - 2020) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Futuros e Opções (2019) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Futuros e Opções (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Futuros e Opções (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Introdução às Finanças Computacionais (2015 - 2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2015) Unidade/Área: Finanças</p>