

**Aviso:** [2024-07-16 09:27] 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.

## José Carlos Dias

### Diretor

Departamento de Finanças (IBS)

### Professor Catedrático

Departamento de Finanças (IBS)

### Investigador Integrado

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



## Contactos

<b>E-mail</b>	Jose.Carlos.Dias@iscte-iul.pt
<b>Gabinete</b>	D5.37
<b>Telefone</b>	217650531 (Ext: 221229)
<b>Cacifo</b>	168

## Currículo

José Carlos Dias is Full Professor of Finance at the Department of Finance of Iscte Business School. He holds a PhD degree in Finance from Iscte and is the Director of the Department of Finance. He was also the Director of the PhD in Finance and the Director of the Master in Finance of Iscte Business School. His current research interests include option pricing, structured products and exotic options, volatility derivatives, real options and credit risk. He has published in the Journal of Banking and Finance, Quantitative Finance, European Journal of Operational Research, European Journal of Finance, Journal of Futures Markets, International Journal of Theoretical and Applied Finance, Review of Derivatives Research, Journal of Derivatives, and Applied Mathematics and Optimization, among others.

## Áreas de Investigação

Option pricing

Structured products and exotic options
Volatility derivatives
Real options
Credit risk

## Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
ISCTE-IUL	Agregação	Finance	2015
ISCTE-IUL	Doutoramento	Finance	2006
ISCTE-IUL	Mestrado	Ciências Empresariais	1998
ISLA - Lisboa	Licenciatura	Gestão de Empresas	1994

## Outras Atividades Profissionais

Período	Tipo de Atividade	Descrição da Atividade	Link para mais informação
Desde 2019	Participação como especialista noutras instituições	Perito da A3ES para ciclos de estudos em funcionamento da área das Finanças	--
Desde 2018	Experiências documentadas e continuadas de educação profissional	Risk Management course of the PG in Data Science for Finance at NOVA IMS	--
Desde 2017	Experiências documentadas e continuadas de educação profissional	Riscos de Mercado e de Crédito course of the PG in Análise e Gestão do Risco at NOVA IMS	--

## Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord.
2024/2025	2º	Engenharia Financeira	Mestrado em Finanças;	Sim
2024/2025	2º	Seminário de Investigação em Finanças I	Doutoramento em Finanças;	Sim
2024/2025	2º	Opções Reais	Mestrado em Finanças;	Sim
2024/2025	2º	Gestão Financeira de Empresas e Projectos I	Mestrado em Engenharia de Telecomunicações e Informática;	Sim
2024/2025	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Doutoramento em Finanças;	Sim

2024/2025	1º	Seminário de Investigação em Finanças II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Engenharia Financeira	Mestrado em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Seminário de Investigação em Finanças I	Doutoramento em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Opções Reais	Mestrado em Finanças;	Sim
2023/2024	2º	Gestão Financeira de Empresas e Projectos I	Mestrado em Engenharia de Telecomunicações e Informática;	Sim
2023/2024	2º	Risco de Crédito	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Doutoramento em Finanças;	Sim
2023/2024	1º	Seminário de Investigação em Finanças II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2023/2024	1º	Projeto de Investigação em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2023/2024	1º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Dissertação em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Engenharia Financeira	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Seminário de Investigação em Finanças I	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Opções Reais	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Opções Financeiras e Produtos Estruturado	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2022/2023	2º	Risco de Crédito	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2022/2023	2º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	2º	Gestão Financeira de Empresas e Projectos I	Mestrado em Engenharia de Telecomunicações e Informática;	Sim
2022/2023	2º	Risco de Crédito	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	1º	Dissertação em Finanças	Mestrado em Finanças;	Sim
2022/2023	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Doutoramento em Finanças;	Sim

2022/2023	1º	Seminário de Investigação em Finanças II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	1º	Projeto de Investigação em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	1º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2022/2023	1º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Engenharia Financeira	Mestrado em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Seminário de Investigação em Finanças I	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Opções Reais	Mestrado em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	2º	Gestão Financeira de Empresas e Projectos I	Mestrado em Engenharia de Telecomunicações e Informática;	Sim
2021/2022	2º	Risco de Crédito	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2021/2022	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	1º	Seminário de Investigação em Finanças II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	1º	Projeto de Investigação em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2021/2022	1º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Engenharia Financeira	Mestrado em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Seminário de Investigação em Finanças I	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Opções Reais	Mestrado em Finanças;	Sim
2020/2021	2º	Opções Financeiras e Produtos Estruturado	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2020/2021	2º	Risco de Crédito	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2020/2021	2º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim

2020/2021	2º	Gestão Financeira de Empresas e Projectos I	Mestrado em Engenharia de Telecomunicações e Informática;	Sim
2020/2021	2º	Risco de Crédito	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	1º	Seminário de Investigação em Finanças II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	1º	Projeto de Investigação em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2020/2021	1º	Tese em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim
2019/2020	2º	Tese em Finanças I		Sim
2019/2020	2º	Tese em Finanças III		Sim
2019/2020	2º	Seminário de Investigação em Finanças I	Doutoramento em Finanças;	Sim
2019/2020	2º	Tese em Finanças V		Sim
2019/2020	2º	Opções Reais	Mestrado em Finanças;	Sim
2019/2020	2º	Gestão Financeira de Empresas e Projectos I	Mestrado em Engenharia de Telecomunicações e Informática;	Sim
2019/2020	2º	Risco de Crédito	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Finanças em Tempo Contínuo	Doutoramento em Finanças;	Sim
2019/2020	1º	Tese em Finanças II		Sim
2019/2020	1º	Tese em Finanças IV		Sim
2019/2020	1º	Seminário de Investigação em Finanças II	Doutoramento em Finanças;	Sim
2019/2020	1º	Projeto de Investigação em Finanças	Doutoramento em Finanças;	Sim

## Orientações

### • Teses de Doutoramento

- Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
--	-------------------	---------------	--------	--------	-------------

1	João Diogo Barros Moura	Financial Options: Options Returns, Hedging Strategy and Static Hedge Portfolio	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL
2	Carlos Miguel Aguiar da Glória	Essays on option pricing	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL
3	Bruno Miguel Teixeira Taborda	MAIS: Market Artificial Intelligence	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL

#### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Fernando Correia da Silva	Three Essays on Option Pricing	Inglês	ISCTE-IUL	2023
2	Yang Fengyue	"Price Dynamics of Farmland Transfer in Chengdu, China: Evidence from a Multilevel Model"	Inglês	ISCTE-IUL	2022
3	João Miguel Mendes dos Reis	Barrier Options and Dynamic Debt	Inglês	ISCTE-IUL	2022
4	Tiago Mota Dutra	Essays on Financial Cycles and Banks' Risk	--	ISCTE-IUL	2021
5	Mário Jorge Correia Fernandes	Three Essays on Modeling Energy Prices with Time-Varying Volatility and Jumps	--	ISCTE-IUL	2021
6	Li Chen	Service quality and customer satisfaction - a case study of nursing homes in Beijing	--	ISCTE-IUL	2019

#### • Dissertações de Mestrado

##### - Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Tânia Patrícia Silva Malta	Testar modelo estrutural de risco de crédito	--	Em curso	ISCTE-IUL

##### - 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	Ana Maria Dias Vicente	Avaliar investimentos em energia eólica onshore com incentivos governamentais utilizando opções reais: o caso Português	Inglês	ISCTE-IUL	2023
3	João Pedro Rodrigues Soares	Comparação dos modelos Black-Scholes e Heston	Inglês	ISCTE-IUL	2023

4	Daniela Fernanda Martinez Vargas	Análise do modelo de market-making no trading de alta frequência para a bolsa de valores norte-americana	Inglês	ISCTE-IUL	2023
5	Raquel Lopes Coutinho	Avaliação de opções através de métodos de machine learning	Português	ISCTE-IUL	2023
6	Margarida Silva Marques	Avaliação de Opções Reais: O Caso dos Percursos Pedestres na Ilha da Madeira	Inglês	ISCTE-IUL	2023
7	Diogo Filipe Sousa Vieira	Cobertura de Carbono	Inglês	ISCTE-IUL	2023
8	Célia dos Santos Subtil	Estímulo Público ao Investimento Privado e Prevenção de Disinvestimento: uma abordagem CEV	Inglês	ISCTE-IUL	2022
9	Yannik Ehlert	Avaliação da opção com o Modelo Heston	Inglês	ISCTE-IUL	2022
10	Ivan Alexandre Costa Guerra	Aplicação de opções reais em projetos de inovação empresarial e I&D	Inglês	ISCTE-IUL	2022
11	Luís Simão Almeida Ferreira	Simulação de Monte Carlo exata de Difusões com Saltos	Português	ISCTE-IUL	2021
12	Rodrigo Sant Ana Lourenço	Modelos estruturais de risco de crédito e os determinantes de credit default swap spreads	Inglês	ISCTE-IUL	2021
13	João Seguro Ildefonso	Repeated Richardson Extrapolation and Static Hedging of Barrier Options	Inglês	ISCTE-IUL	2021
14	Joana Margarida de Sousa Barbosa	Será o Preço dos Produtos Estruturados Justo? - Barrier Reverse Convertibles e Turbo Warrants do Mercado Suíço	Inglês	ISCTE-IUL	2020
15	Catarina Isabel dos Santos Oliveira	A avaliação de produtos estruturados em Portugal: Qual foi o impacto causado no preço dos produtos depois do protocolo da CMVM ter entrado em vigor em 2014?	Inglês	ISCTE-IUL	2020
16	Hugo António Figueiredo Matias	Derivados Voláteis - Retorno Esperado das Opções	Inglês	ISCTE-IUL	2019
17	Aricson Cesar Jesus da Cruz	Essays on Option Pricing	--	ISCTE-IUL	2019
18	Vítor Hugo Ferreira Pinto	Performance empírica de três modelos de precificação de opções	Inglês	ISCTE-IUL	2018
19	Inês Pereira Santos	Modelos estruturais de risco de crédito: análise de empresas cotadas em Portugal	Inglês	ISCTE-IUL	2018
20	Carlos Sérgio Serrado Ramos Ricardo	Construção do Novo Edifício Sede do Município de Oeiras. Análise de viabilidade económico-financeira	Português	ISCTE-IUL	2018

21	Igor Viktorovich Kravchenko	Valuation of Financial Derivatives through transmutation operator methods	--	ISCTE-IUL	2018
22	Catarina da Silva Ferro Costa Pereira	Testing High Volatility Expectation Trades on Macroeconomic and Political Events of 2016	Inglês	ISCTE-IUL	2017
23	André Gonçalo Lopes Fernandes	Structured Products Insights: Pricing reverse convertibles and discount certificates in the german market	Inglês	ISCTE-IUL	2017
24	Mário Raul Santiago do Céu	Análise da Evolução do Risco de Crédito na Agricultura em Portugal	Português	ISCTE-IUL	2017
25	Pedro Filipe Botelho Negrão de Sousa	Algorithms for Improving the Efficiency of CEV, CIR and JDCEV Option Pricing Models	Inglês	ISCTE-IUL	2017
26	Marcelo Bettencourt Santos Nunes Capitão	Análise das Metodologias de Seleção de Projetos de Investimentos das PME	Português	ISCTE-IUL	2016
27	Qi Dong	Credit Risk Measurement of the Listed Companies in China Based on Kmv Model	Inglês	ISCTE-IUL	2016
28	Svetlana Klimova	Real Options Valuation - Investment Under New Technological Adoption and Carbon Policy Uncertain: An application to Volkswagen automobile industry	Inglês	ISCTE-IUL	2016
29	João Miguel Mendes Carrilho	Stock Market Returns and Football Match Results	Inglês	ISCTE-IUL	2015
30	Vincent Jean Maurice Mouralis	Commodity Futures in Portfolio Allocation	Inglês	ISCTE-IUL	2015
31	Antoine Hugo Mairal	Equity-Linked Structured Products: A complex Industry in evolution	Inglês	ISCTE-IUL	2015
32	Sara Maria Correia Pereira	Pricing of a Credit Default Swap	Inglês	ISCTE-IUL	2015
33	Carlos António Fernandes Casimiro	Structural Models in Credit Risk	Inglês	ISCTE-IUL	2015
34	Filipe Luís Abraúl Rosa Gonçalves Pereira	The Kim(1990) American Options Valuation Method: A comparative analysis	Inglês	ISCTE-IUL	2014
35	Marcelo Gomes Raposo dos Santos Pereira	The Cyclical Behavior of Commodities and their Investment Benefits	Inglês	ISCTE-IUL	2013
36	João Pedro Bento Ruas	Three Essays on the Valuation of American-Style Options	Inglês	ISCTE-IUL	2013
37	Catarina Filipa Lopes Ramos	Measuring Perceived Service Quality at Portuguese Helthcare Centres: The moderating effect of outsourcing a core activity	Inglês	ISCTE-IUL	2012



38	Ana Cristina dos Santos Oliveira	Avaliação Da Qualidade Percebida Dos Serviços Académicos De Uma Universidade Portuguesa	Português	ISCTE-IUL	2012
39	Gustavo de Souza Barros	Variable Volatility in Option Pricing	Inglês	ISCTE-IUL	2012

## • Projetos Finais de Mestrado

### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Lamberto Lorini Sgariboldi	Avaliação do Desenvolvimento de um Novo Medicamento: VIR-7831 Case Study	Inglês	ISCTE-IUL	2021
2	Neuza Carina Pires dos Santos	Linha ferroviária de alta velocidade entre Lisboa e Madrid: sim ou não? A perspetiva de opções reais	Inglês	ISCTE-IUL	2019
3	João Pereira Pedro de Jesus	Oferta Pública de Aquisição do CaixaBank sobre o BPI: O Impacto na Ação do BPI	Inglês	ISCTE-IUL	2018
4	Diogo Correia Rino	Costly Reversible Disinvestment Option in a Valuation of Renewable Energy case	Inglês	ISCTE-IUL	2017
5	João Luís Navarro de Castro Correia Botelho	Avaliação de Empresas através de Múltiplos de Mercado - O caso da REN	Português	ISCTE-IUL	2017
6	Ana Clara de Matos Soares Pereira Jacinto Talefe	Estudo sobre a Eficiência das Carteiras de Investimentos das Seguradoras Vida em Portugal	Português	ISCTE-IUL	2016
7	João Pedro Robalo Martins	European Inflation-Linked Bonds: An historical overview and the benefits Amid Portfolio Management	Inglês	ISCTE-IUL	2015
8	Miguel Seixas do Val Ferreira	Decomposition of a Financial Structured Product "Lloyds double up	Inglês	ISCTE-IUL	2014
9	Carolina Albardeiro Santana	Modelos de Risco de Crédito: Análise de Telecoms Europeias e Bancos Americanos	Português	ISCTE-IUL	2014
10	Mário António Limede	Modelos de Avaliação de Risco de Crédito - Análise e Aplicação	Português	ISCTE-IUL	2013
11	Pedro Marzagão Barbuto	LSMC for Pricing American Options under the Heston Model	Inglês	ISCTE-IUL	2013
12	Paulo Fernando Marques Ferreira	Evaluating Investment Opportunities under Different Model Dynamics: Some Managerial Insights	Inglês	ISCTE-IUL	2012
13	João de Andrade Dias da Costa	Carbon Markets and Emission Derivatives - pricing of derivatives in the EU ETS	Inglês	ISCTE-IUL	2012

14	Carla Alexandra Botas Prates	Pricing and Hedging Volatility Options.	--	ISCTE-IUL	2011
15	Jorge Manuel Duque de Oliveira	Pricing Corporate Debt Risk Under The Cev Model.	Inglês	ISCTE-IUL	2011

## Total de Citações

<b>Web of Science®</b>	181
<b>Scopus</b>	166

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	Taborda, B., de Almeida, A., Dias, J. C., Batista, F. & Ribeiro, R. (N/A). SA-MAIS: Hybrid automatic sentiment analyser for stock market. Journal of Information Science. N/A
2	Glória, C. M., Dias, J. C. & Cruz, A. (2024). Pricing levered warrants under the CEV diffusion model. Review of Derivatives Research. 27 (1), 55-84
3	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2024). Performance comparison of alternative stochastic volatility models and its determinants in energy futures: COVID19 and Russia-Ukraine conflict features. Journal of Futures Markets. 44 (3), 343-383
4	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (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 - N.º de citações Google Scholar: 2
5	Dutra, T. M., Teixeira, J. C. A. & Dias, J. C. (2023). The effect of political institutions on the interplay between banking regulation and banks' risk. Journal of Banking Regulation. N/A - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 5
6	Dutra, T. M., Teixeira, J. C. A. & Dias, J. C. (2023). Banking regulation and banks' risk-taking behavior: The role of investors' protection. The Quarterly Review of Economics and Finance. 90, 124-148 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 6
7	Fernandes, M. C, Dutra, T. M., Dias, J. C. & Teixeira, J. C. A. (2023). Modelling output gaps in the Euro Area with structural breaks: The COVID-19 recession. Economic Analysis and Policy. 78, 1046-1058
8	Dutra, T. M., Dias, J. C. & Teixeira, J. C. A. (2022). Measuring financial cycles: Empirical evidence for Germany, United Kingdom and United States of America. International Review of Economics and Finance. 79, 599-630 - N.º de citações Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 5 - N.º de citações Google Scholar: 8

9	<p>Kravchenko, I., Kravchenko, V. V., Torba, S. M. &amp; Dias, J. C. (2022). Generalized exponential basis for efficient solving of homogeneous diffusion free boundary problems: Russian option pricing. <i>Journal of Mathematical Sciences</i>. 266, 353-377</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 6</p>
10	<p>Larguinho, M., Dias, J. C. &amp; Braumann, C. A. (2022). Pricing and hedging bond options and sinking-fund bonds under the CIR model. <i>Quantitative Finance and Economics</i>. 6 (1), 1-34</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 1</p>
11	<p>Proença, C., Neves, M., Dias, J. C. &amp; Martins, P. (2022). Determinants of sovereign debt ratings in clusters of European countries – effects of the crisis. <i>Journal of Financial Economic Policy</i>. 14 (3), 403-427</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 4</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 9</p>
12	<p>Fernandes, M. C, Dias, J. C. &amp; Nunes, J. (2021). Modeling energy prices under energy transition: A novel stochastic-copula approach. <i>Economic Modelling</i> . 105</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 6</p> <p>- N.º de citações Scopus: 9</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 13</p>
13	<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> <p>- N.º de citações Web of Science®: 8</p> <p>- N.º de citações Scopus: 7</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 12</p>
14	<p>Dias, J. C., Nunes, J. &amp; Cruz, A. (2020). A note on options and bubbles under the CEV model: Implications for pricing and hedging. <i>Review of Derivatives Research</i>. 23 (3), 249-272</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 5</p> <p>- N.º de citações Scopus: 4</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 10</p>
15	<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> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 5</p>
16	<p>Cruz, A. &amp; Dias, J. C. (2020). Valuing American-style options under the CEV model: an integral representation based method. <i>Review of Derivatives Research</i>. 23 (1), 63-83</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 3</p> <p>- N.º de citações Scopus: 3</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 6</p>
17	<p>Kravchenko, I., Kravchenko, V. V., Torba, S. M. &amp; Dias, J. C. (2019). Pricing double barrier options on homogeneous diffusions: a Neumann series of Bessel functions representation. <i>International Journal of Theoretical and Applied Finance</i>. 22 (6)</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Scopus: 3</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 3</p>

18	<p>Dias, J. C. &amp; Nunes, J. P. V. (2018). Universal recurrence algorithm for computing Nuttall, generalized Marcum and incomplete Toronto functions and moments of a noncentral <math>x^2</math> random variable. <i>European Journal of Operational Research</i> . 265 (2), 559-570</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 2</li> <li>- N.º de citações Scopus: 1</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 5</li> </ul>
19	<p>Cruz, A. &amp; Dias, J. C. (2017). The binomial CEV model and the Greeks. <i>Journal of Futures Markets</i>. 37 (1), 90-104</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 6</li> <li>- N.º de citações Scopus: 5</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 8</li> </ul>
20	<p>Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. &amp; Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. <i>Journal of Derivatives</i>. 23 (4), 20-32</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 1</li> <li>- N.º de citações Scopus: 1</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 2</li> </ul>
21	<p>Dias, J. C., Nunes, J. P. V. &amp; 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</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 16</li> <li>- N.º de citações Scopus: 13</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 22</li> </ul>
22	<p>Nunes, J., Ruas, J. &amp; 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</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 16</li> <li>- N.º de citações Scopus: 13</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 22</li> </ul>
23	<p>Larguinho, M., Dias, J. C. &amp; Braumann, C. A. (2013). On the computation of option prices and Greeks under the CEV Model. <i>Quantitative Finance</i>. 13 (6), 907-917</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 33</li> <li>- N.º de citações Scopus: 29</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 48</li> </ul>
24	<p>Ruas, J. P., Dias, J. C. &amp; 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</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 24</li> <li>- N.º de citações Scopus: 18</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 34</li> </ul>
25	<p>Dias, J. C. &amp; Shackleton, M. B. (2011). Hysteresis effects under CIR interest rates. <i>European Journal of Operational Research</i>. 211 (3), 594-600</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 11</li> <li>- N.º de citações Scopus: 14</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 21</li> </ul>
26	<p>Dias, J. C. &amp; Nunes, J. P. (2011). Pricing real options under the constant elasticity of variance diffusion. <i>Journal of Futures Markets</i>. 31 (3), 230-250</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 30</li> <li>- N.º de citações Scopus: 26</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 47</li> </ul>

27	<p>Dias, J. C. &amp; Shackleton, M. B. (2009). Durable vs. disposable equipment choice under interest rate uncertainty. <i>European Journal of Finance</i>. 15 (2), 157-167</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 2</p> <p>- N.º de citações Scopus: 2</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 4</p>
----	---

## • Livros e Capítulos de Livros

### - Autor de livro

1	<p>Dias, J. C. (2014). <i>Hysteresis: Types, Applications and Behavior Patterns in Complex Systems</i>.</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 1</p>
---	--

### - Editor de livro

1	<p>Dias, J. C. (2014). <i>Hysteresis: Types, Applications and Behavior Patterns in Complex Systems</i>. New York / USA. Nova Science Publishers.</p>
---	--

### - Capítulo de livro

1	<p>Dias, J. C., Larguinho, M. &amp; Braumann, C.A. (2014). Valuation of Bond Options under the CIR Model: Some Computational Remarks. In Pacheco, A., Santos, R., Oliveira, M.R., and Paulino, C.D. (Ed.), <i>New Advances in Statistical Modeling and Applications, Studies in Theoretical and Applied Statistics</i>. (pp. 125-133): Springer.</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 1</p>
2	<p>Dias, J. C. &amp; Larguinho, M. (2014). Hysteresis Effects and First Passage Time Densities under Alternative Modeling Architecture Assumptions. In Dias, J.C. (Ed.), <i>Hysteresis: Types, Applications and Behavior Patterns in Complex Systems</i>. (pp. 1-17). New York / USA: Nova Science Publishers.</p>
3	<p>Dias, J.C., Larguinho, M. &amp; Braumann, C.A. (2012). Absolute Diffusion Process: Sensitivity Measures. In <i>Advances in Regression, Survival Analysis, Extreme Values, Markov Processes and Other Statistical Applications, Studies in Theoretical and Applied Statistics</i>. (pp. 233-241): Springer.</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 1</p>
4	<p>Dias, J.C., Larguinho, M. &amp; Braumann, C.A. (2012). A Note on (Dis)Investment Options and Perpetuities under CIR Interest Rates. In <i>Recent Developments in Modeling and Applications in Statistics, Studies in Theoretical and Applied Statistics</i>. (pp. 203-211): Springer.</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 1</p>

## • Conferências/Workshops e Comunicações

### - Comunicação em evento científico

1	<p>Barbosa, L., Dias, J. C. &amp; Marques, M. (2024). Subsidies and Sustainable Tourism: Balancing Demand Guarantees With Environmental Damage From Tourism. The 27th Annual International Real Options Conference .</p>
2	<p>Dias, J. C. (2023). Caps, Floors and Collars Contractual Agreements and Optimal Investment Decisions. 1st SDE - Stochastic Days Encounters: Applications of Stochastic Differential Equations.</p>

3	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2023). The Behaviour of Stochastic Volatility in Energy Futures Contracts with the COVID- 19 and the Russia-Ukraine Conflict. 12th International Conference of the Financial Engineering and Banking Society.
4	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.
5	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.
6	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. Informs Annual Meeting.
7	Dutra, T. M., Teixeira, J. C. A. & Dias, J. C. (2022). Banking Regulation and Banks' Risk-Taking Behavior: The Role of Investors' Protection. 31st European Financial Management Association (EFMA) Conference.
8	Dutra, T. M., Dias, J. C. & Teixeira, J. C. A. (2022). Measuring Financial Cycles: Empirical Evidence for Germany, United Kingdom and United States of America. 29th Annual Global Finance Conference.
9	Reis, J. & Dias, J. C. (2022). Dynamic Debt with Intensity Based Models. 29th Annual Global Finance Conference.
10	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. 19th EUROPT Workshop on Advances in Continuous Optimization.
11	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2022). Modeling Energy Futures Prices Under Alternative Time-Varying Volatility Dynamics. 29th Annual Global Finance Conference.
12	Dutra, T. M., Teixeira, J. C. A. & Dias, J. C. (2022). The Effect of Political Institutions on the Interplay Between Banking Regulation and Banks' Risk. International Society for the Advancement of Financial Economics (ISAFE). - N.º de citações Google Scholar: 1
13	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.
14	Dutra, T. M., Teixeira, J. C. A. & Dias, J. C. (2021). Banking Regulation and Banks' Risk-Taking Behavior: The Role of Investors' Protection. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.
15	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling Electricity and Natural Gas Prices under the Electrification of Energy Firms. 14th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal.
16	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling Commodity Prices under Alternative Jump Processes and Fat Tails Dynamics. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.
17	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.
18	Gloria, C. M., Dias, J. C. & Cruz, A. (2021). Pricing Levered Warrants under the CEV Diffusion Model. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.

19	Kravchenko, I., Kravchenko, V. V., Torba, S. M. & Dias, J. C. (2019). A Numerical Method Based on Transmutation Operators for (Free) Boundary Problems Arising in Mathematical Finance. XXIV Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
20	Dias, J. C. (2019). A Note on the Loss of the Martingale Property under the CEV Process. XXIV Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
21	Dias, J. C. (2019). A Note on the Loss of the Martingale Property under the CEV Process. VI Workshop on Computational Data Analysis and Numerical Methods.
22	Dias, J. C., Kravchenko, I. V. , Kravchenko, V. V. & Torba, S. M. (2018). Pricing Double Barrier Options on Homogeneous Diffusions: A Neumann Series of Bessel Functions Representation. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network.
23	Dias, J. C., Larginho, M. & Braumann, C.A. (2018). Entry and Exit Decisions under Uncertainty for a Generalized Class of One-Dimensional Diffusions. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network. - N.º de citações Google Scholar: 2
24	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 12th Workshop on Statistics, Mathematics and Computation.
25	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network.
26	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.
27	Dias, J. C., Kravchenko, I. V. , Kravchenko, V. V. & Torba, S. M. (2018). Generalized Exponential Basis for Efficient Solving of Homogeneous Diffusion Free Boundary Problems: Russian Option Pricing. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society. - N.º de citações Google Scholar: 5
28	Dias, J. C., Kravchenko, I. V. , Kravchenko, V. V. & Torba, S. M. (2018). Application of the Transmutation Operators to Parabolic Boundary and Free Boundary Problems. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society.
29	Dias, J. C., Laureano, L. & Nunes, J. (2017). Corporate Security Valuation under a Barrier Option Framework with State-Dependent Volatility. 5th Paris Financial Management Conference.
30	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Computation of Three Discrete Distribution Mixtures of Continuous Distributions: Stability Analysis. 11th International Conference on Computational and Financial Econometrics.
31	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
32	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Cálculo Computacional de Misturas Discretas de Distribuições Contínuas: Revisão do Método de Benton e Krishnamoorthy. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
33	Kravchenko, I. V. , Kravchenko, V. V., Torba, S. M. & Dias, J. C. (2017). Application of the Transmutation Operators to Parabolic Free Boundary Problems. A Numerical Method. INFORMS Annual Meeting.

34	Proença, C., Dias, J. C. & Neves, E. (2017). Determinants of Sovereign Debt Ratings: Effects of the Crisis. XVI Congresso Internacional de Contabilidade e Auditoria.
35	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 2nd International Conference on Computational Finance.
36	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.
37	Dias, J. C. & Nunes, J. (2016). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
38	Dias, J. C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2016). Pricing and Hedging Bond Options and Sinking-Fund Bonds under the CIR Framework. 23rd International Conference on Forecasting Financial Markets: Advances for Exchange Rates, Interest Rates and Asset Management.
39	Dias, J. C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2015). Entry and Exit Decisions under Output Price Uncertainty: A Generalized Class of One-Dimensional Diffusions. 19th International Conference on Real Options.
40	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2014). Static Hedging and Early Exercise Boundaries for American-style Barrier Options. 8th World Congress of the Bachelier Finance Society.
41	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of American-style Double Knock-In Options. Mathematical Finance Workshop: Stochastic Analysis and Numerical Approximations in Mathematical Finance.
42	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of European-style Double Barrier Options under the Jump to Default Extended CEV Model. 8th International Conference of the Portuguese Finance Network.
43	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). In-Out Parity Relations and Early Exercise Boundaries for American-Style Barrier Options. FMA 17th European Conference.
44	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. FMA 17th European Conference.
45	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Truncated Moments of a Noncentral $\chi^2$ Random Variable: An Extension of the Benton and Krishnamoorthy Approach. XX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
46	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2012). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. INFORMS Annual Meeting.
47	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. Mathematical Finance Days Conference.
48	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Pricing Double Barrier Options under the CEV Process: A Speed-Accuracy Comparison of Alternative Methods. 7th World Congress of the Bachelier Finance Society.
49	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2012). Bond Options, Sensitivity Measures, and Sinking-Fund Bonds under the CIR Framework. 7th International Conference of the Portuguese Finance Network.
50	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. 7th International Conference of the Portuguese Finance Network.



51	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering.
52	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2012). Medidas de Sensibilidade para Opções sobre Obrigações sob o Modelo CIR. XX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
53	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2011). Análise da Distribuição Chi-Quadrado Não Central na Avaliação de Opções Europeias num Processo de Difusão CIR. XIX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
54	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 21st Annual Derivatives Securities and Risk Management Conference.
55	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2011). Speed and Accuracy Comparison of Noncentral Chi-Square Distribution Methods for Option Pricing and Hedging under the CEV Model. Mathematical Finance Days Conference. - N.º de citações Google Scholar: 2
56	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2011). Speed and Accuracy Comparison of Noncentral Chi-Square Distribution Methods for Option Pricing and Hedging under the CEV Model. 18th International Conference on Forecasting Financial Markets: Advances for Exchange Rates, Interest Rates and Asset Management. - N.º de citações Google Scholar: 2
57	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. International Conference on Mathematical Finance and Economics.
58	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2011). Valuation of Non-Central Chi-Square Distribution Methods for Options On Zero Coupon Bonds under The CIR Diffusion. 16th Congresso da AECA.
59	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2010). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 6th World Congress of the Bachelier Finance Society.
60	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2010). Speed and Accuracy Comparison of Noncentral Chi-Square Distribution Methods for Option Pricing and Hedging. 6th International Conference of the Portuguese Finance Network.
61	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2010). Comparação Numérica de Métodos de Cálculo das Perpetuidades sob a Difusão CIR. XVIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
62	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2009). Processo Estocástico de Difusão Absoluta: Medidas de Sensibilidade. XVII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
63	Dias, J.C. & Shackleton, M. B (2009). Investment Hysteresis and Hitting Time for Mean-Reverting CIR Diffusions. 13th International Conference on Real Options.
64	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 12th International Conference on Real Options.
65	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 5th International Conference of the Portuguese Finance Network.

## • Outras Publicações

### - Outras publicações

1	Taborda, B., de Almeida, A., Dias, J. C., Batista, F. & Ribeiro, R. (2021). Stock Market Tweets Data. IEEE Dataport.
2	Dias, J. C. (2018). Avaliação de opções standard e barreira com o modelo CEV. Boletim da Sociedade Portuguesa de Estatística. Outono, 49-56
3	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

Presidente (2022 - 2026)

Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2022 - 2026)

Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2022 - 2026)

Unidade/Área: Departamento de Finanças

Vice-Presidente (2021 - 2023)

Unidade/Área: Conselho Científico

Membro (Docente) (2021 - 2023)

Unidade/Área: Comissão Permanente do Conselho Científico

Membro (Docente) (2021 - 2023)

Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Director (2021 - 2022)

Unidade/Área: [5563] Finanças

Membro (Docente) (2019 - 2021)

Unidade/Área: Comissão Permanente do Conselho Científico

Membro (Docente) (2019 - 2021)

Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Director (2019 - 2021)

Unidade/Área: [5563] Finanças

Membro (2018 - 2022)

Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2018 - 2022)

Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro (Docente) (2018 - 2022)

Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2017 - 2019)

Unidade/Área: [5563] Finanças

Director (2015 - 2017)

Unidade/Área: [5563] Finanças

Director (2015)

Unidade/Área: [B24] Finanças

Membro (2014 - 2018)  
Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2014 - 2018)  
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro (Docente) (2014 - 2018)  
Unidade/Área: Comissão Científica

Director (2013 - 2015)  
Unidade/Área: [B24] Finanças

## Actividades de Edição/Revisão Científica

Tipo de Actividade	Título da Revista	ISSN/Quartil	Período	Língua
Membro de equipa editorial de revista	Coimbra Business Review		--	Inglês
Membro de equipa editorial de revista	Journal of Finance and Economics		--	Inglês