

Aviso: [2026-04-06 04:09] 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.

José Carlos Dias

Professor Catedrático

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



Contactos

| | |
|-----------------|-------------------------------|
| E-mail | Jose.Carlos.Dias@iscte-iul.pt |
| Gabinete | D5.23 |
| Telefone | 217650531 (Ext: 221229) |
| Cacifo | 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 and real options. 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. He is currently the Editor-in-Chief of the Review of Derivatives Research.

Áreas de Investigação

| |
|--|
| Option pricing |
| Structured products and exotic options |
| Volatility derivatives |

Real options

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. |
|------------|------|---|---------------------------|--------|
| 2025/2026 | 2º | Engenharia Financeira | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2025/2026 | 2º | Opções Reais | Mestrado em Finanças; | Sim |
| 2025/2026 | 2º | Gestão Financeira de Empresas e Projectos I | | Sim |
| 2025/2026 | 1º | Finanças em Tempo Contínuo | Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2025/2026 | 1º | Estratégia Financeira da Empresa | | Sim |
| 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 | Opções Financeiras e Produtos Estruturado | Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros; | Sim |
| 2024/2025 | 2º | Risco de Crédito | Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros; | Sim |
| 2024/2025 | 2º | Análise de projetos de investimento | Outro em PG Contabilidade e Análise Financeira para a Gestão; | Não |
| 2024/2025 | 2º | Gestão Financeira de Empresas e Projectos I | | 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 | | Sim |
| 2023/2024 | 2º | Risco de Crédito | | 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 | | Sim |
| 2023/2024 | 1º | Tese em Finanças | Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Dissertação 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 | | 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 | | Sim |
| 2022/2023 | 2º | Risco de Crédito | | Sim |
| 2022/2023 | 1º | Dissertação 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 | | Sim |
| 2022/2023 | 1º | Tese 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 | | 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 | | Sim |
| 2021/2022 | 2º | Risco de Crédito | | 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 | | Sim |
| 2021/2022 | 1º | Tese em Finanças | Doutoramento em Finanças; | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Engenharia Financeira | | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Seminário de Investigação em Finanças I | Doutoramento em Finanças; | Sim |

| | | | | |
|-----------|----|---|--|-----|
| 2020/2021 | 2º | Tese em Finanças | | Não |
| 2020/2021 | 2º | Opções Reais | | 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 | | Sim |
| 2020/2021 | 2º | Risco de Crédito | | 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 | | 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 | | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Gestão Financeira de Empresas e Projectos I | | Sim |
| 2019/2020 | 2º | Risco de Crédito | | 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 | Luís Miguel Nunes Gaspar | Essays on the European Union Emissions Trading System (EU ETS): price behavior and volatility, forecasting and market influences | Inglês | Em curso | Iscte |
| 2 | Bruno Miguel Teixeira Taborda | MAIS: Market Artificial Intelligence | Inglês | Em curso | Iscte |
| 3 | João Diogo Barros Moura | Financial Options: Options Returns, Hedging Strategy and Static Hedge Portfolio | Inglês | Em curso | Iscte |
| 4 | Célia dos Santos Subtil | Valuation of Standing Timber: a CEV and MC approach | Inglês | Em curso | Iscte |
| 5 | Luís Simão Almeida Ferreira | Exact Simulation of Jump Diffusion Processes | Inglês | Em curso | Iscte |

- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|---|--------------------------------|---|--------|-------------|------------------|
| 1 | Carlos Miguel Aguiar da Glória | Essays on Dynamic Asset Pricing | Inglês | Iscte | 2024 |
| 2 | Fernando Correia da Silva | Caps, floors and collars on continuous flows and investment decisions | Inglês | Iscte | 2023 |
| 3 | Yang Fengyue | "Price Dynamics of Farmland Transfer in Chengdu, China: Evidence from a Multilevel Model" | Inglês | Iscte | 2022 |
| 4 | João Miguel Mendes dos Reis | Barrier Options and Dynamic Debt | Inglês | Iscte | 2022 |
| 5 | Tiago Mota Dutra | Essays on Financial Cycles and Banks' Risk | -- | Iscte | 2021 |
| 6 | Mário Jorge Correia Fernandes | Three Essays on Modeling Energy Prices with Time-Varying Volatility and Jumps | -- | Iscte | 2021 |
| 7 | Li Chen | Service quality and customer satisfaction - a case study of nursing homes in Beijing | -- | Iscte | 2019 |
| 8 | Aricson Cesar Jesus da Cruz | Essays on Option Pricing | -- | Iscte | 2019 |

| | | | | | |
|----|-----------------------------|---|--------|-------|------|
| 9 | Igor Viktorovich Kravchenko | Valuation of Financial Derivatives through transmutation operator methods | -- | Iscte | 2018 |
| 10 | João Pedro Bento Ruas | Three Essays on the Valuation of American-Style Options | Inglês | Iscte | 2013 |

• 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 | Xavier Magalhães Cruz | Framework de Pricing de Swaptions CMS com Diferenciação Algorítmica em Modo Reverso (AAD) | -- | Em curso | Iscte |
| 3 | Afonso de Oliveira Espada Gonçalves Duarte | Arbitragem entre exchanges descentralizadas e centralizadas: um modelo automatizado para Ethereum/Tether Dollar | -- | Em curso | Iscte |
| 4 | Rodrigo Mendonça Remédio Rodrigues de Carvalho | Avaliação da Galp Energia | -- | Em curso | Iscte |
| 5 | Gonçalo Ferraz Pinto | Trading entre regimes: Aprendizagem por Reforço Profundo Sensível a Regimes para Alocação de Ativos | -- | Em curso | Iscte |
| 6 | Adriana Costa Ventura | Valuation of spread options; Avaliação de opções spread | -- | Em curso | Iscte |
| 7 | Mariana Silvina Ariscain Roca | Valuation of Revolut | -- | 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 derivados 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 | Tiago Miguel Soares Reis Baborro | Atribuição de Ganhos e Perdas e Avaliação de Opções | Português | Iscte | 2025 |

| | | | | | |
|----|---|---|-----------|-------|------|
| 4 | Bruno Xavier Ventura de Matos | Investimento em Capacidade Estratégica Sob Incerteza: Insights Matemáticos e Aplicações Práticas | Inglês | Iscte | 2025 |
| 5 | Francisco Manuel Pereira Correia de Cardoso Rodrigues | Efeitos do Modelo Black-Scholes Fracionário em opções LEAPS | Inglês | Iscte | 2025 |
| 6 | Pedro Henrique Andrade Canteiro | Construção de um sistema de trend trading - Um guia de análise técnica | Inglês | Iscte | 2025 |
| 7 | Beatriz Maurício Arantes Tomé | Modelos de Machine Learning na Avaliação do Risco de Crédito | Português | Iscte | 2024 |
| 8 | João de Almeida Martins | "Caps" e "Floors" de maturidade finita para opções de troca em "flows" contínuos. | Inglês | Iscte | 2024 |
| 9 | João Frederico Freitas Silva | Calibração de Opções do Índice S&P 500 Sob Formulações Alternativas do Modelo de Heston (1993) | Inglês | Iscte | 2024 |
| 10 | Joana Neves Andrade Silvano | Feed-in tariffs: ferramenta de incentivo ao investimento em projetos de hidrogénio verde | Inglês | Iscte | 2024 |
| 11 | Francisco Santos Simões | Testar Metodologias Alternativas para calibrar o Modelo de Heston com Jumps para opções de índice S&P500 | Inglês | Iscte | 2024 |
| 12 | Ana Carolina Neves Teles Evangelista Serrão | Unveiling the Potential: Valuing Onshore and Offshore Wind Energies through Real Options Perspective | Inglês | Iscte | 2024 |
| 13 | Diogo Filipe da Conceição Rolo | Como pequenas redes neuronais podem melhorar estratégias nos mercados financeiros | Inglês | Iscte | 2024 |
| 14 | Mariana Fernandes Carvalho | Risco de incumprimento no crédito à habitação - O caso de Portugal | Inglês | Iscte | 2024 |
| 15 | Rita Sofia Marques Pedro | Caps e Floors perpétuos sobre fluxos contínuos: Aplicações sobre taxas de juros | Português | Iscte | 2024 |
| 16 | Beatriz Maria Ribeiro Ferrão | O impacto dos ESG Pillars nas decisões de distribuição de lucro das empresas dos países pertencentes ao grupo G7. | Inglês | Iscte | 2024 |
| 17 | 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 | 2023 |
| 18 | Ana Maria Dias Vicente | Avaliar investimentos em energia eólica onshore com incentivos governamentais utilizando opções reais: o caso Português | Inglês | Iscte | 2023 |
| 19 | João Pedro Rodrigues Soares | Comparação dos modelos Black-Scholes e Heston | Inglês | Iscte | 2023 |

| | | | | | |
|----|---------------------------------------|--|-----------|-------|------|
| 20 | Daniela Fernanda Martinez Vargas | Análise do modelo de market-making no trading de alta frequência para a bolsa de valores norte-americana | Inglês | Iscte | 2023 |
| 21 | Raquel Lopes Coutinho | Avaliação de opções através de métodos de machine learning | Português | Iscte | 2023 |
| 22 | Margarida Silva Marques | Avaliação de Opções Reais: O Caso dos Percursos Pedestres na Ilha da Madeira | Inglês | Iscte | 2023 |
| 23 | Diogo Filipe Sousa Vieira | Cobertura de Carbono | Inglês | Iscte | 2023 |
| 24 | Célia dos Santos Subtil | Estímulo Público ao Investimento Privado e Prevenção de Disinvestimento: uma abordagem CEV | Inglês | Iscte | 2022 |
| 25 | Yannik Ehlert | Avaliação da opção com o Modelo Heston | Inglês | Iscte | 2022 |
| 26 | Ivan Alexandre Costa Guerra | Aplicação de opções reais em projetos de inovação empresarial e I&D | Inglês | Iscte | 2022 |
| 27 | Luís Simão Almeida Ferreira | Simulação de Monte Carlo exata de Difusões com Saltos | Português | Iscte | 2021 |
| 28 | Rodrigo Sant Ana Lourenço | Modelos estruturais de risco de crédito e os determinantes de credit default swap spreads | Inglês | Iscte | 2021 |
| 29 | João Seguro Ildefonso | Repeated Richardson Extrapolation and Static Hedging of Barrier Options | Inglês | Iscte | 2021 |
| 30 | Joana Margarida de Sousa Barbosa | Será o Preço dos Produtos Estruturados Justo? - Barrier Reverse Convertibles e Turbo Warrants do Mercado Suíço | Inglês | Iscte | 2020 |
| 31 | 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 | 2020 |
| 32 | Hugo António Figueiredo Matias | Derivados Voláteis - Retorno Esperado das Opções | Inglês | Iscte | 2019 |
| 33 | Vitor Hugo Ferreira Pinto | Performance empírica de três modelos de precificação de opções | Inglês | Iscte | 2018 |
| 34 | Carlos Sérgio Serrado Ramos Ricardo | Construção do Novo Edifício Sede do Município de Oeiras. Análise de viabilidade económico-financeira | Português | Iscte | 2018 |
| 35 | Inês Pereira Santos | Modelos estruturais de risco de crédito: análise de empresas cotadas em Portugal | Inglês | Iscte | 2018 |
| 36 | Catarina da Silva Ferro Costa Pereira | Testing High Volatility Expectation Trades on Macroeconomic and Political Events of 2016 | Inglês | Iscte | 2017 |

| | | | | | |
|----|---|--|-----------|-------|------|
| 37 | André Gonçalo Lopes Fernandes | Structured Products Insights: Pricing reverse convertibles and discount certificates in the german market | Inglês | Iscte | 2017 |
| 38 | Mário Raul Santiago do Céu | Análise da Evolução do Risco de Crédito na Agricultura em Portugal | Português | Iscte | 2017 |
| 39 | Pedro Filipe Botelho Negrão de Sousa | Algorithms for Improving the Efficiency of CEV, CIR and JDCEV Option Pricing Models | Inglês | Iscte | 2017 |
| 40 | Marcelo Bettencourt Santos Nunes Capitão | Análise das Metodologias de Seleção de Projetos de Investimentos das PME | Português | Iscte | 2016 |
| 41 | Svetlana Klimova | Real Options Valuation - Investment Under New Technological Adoption and Carbon Policy Uncertain: An application to Volkswagen automobile industry | Inglês | Iscte | 2016 |
| 42 | Qi Dong | Credit Risk Measurement of the Listed Companies in China Based on Kmv Model | Inglês | Iscte | 2016 |
| 43 | João Miguel Mendes Carrilho | Stock Market Returns and Football Match Results | Inglês | Iscte | 2015 |
| 44 | Vincent Jean Maurice Mouralis | Commodity Futures in Portfolio Allocation | Inglês | Iscte | 2015 |
| 45 | Antoine Hugo Mairal | Equity-Linked Structured Products: A complex Industry in evolution | Inglês | Iscte | 2015 |
| 46 | Sara Maria Correia Pereira | Pricing of a Credit Default Swap | Inglês | Iscte | 2015 |
| 47 | Carlos António Fernandes Casimiro | Structural Models in Credit Risk | Inglês | Iscte | 2015 |
| 48 | Filipe Luís Abraúl Rosa Gonçalves Pereira | The Kim(1990) American Options Valuation Method: A comparative analysis | Inglês | Iscte | 2014 |
| 49 | Marcelo Gomes Raposo dos Santos Pereira | The Cyclical Behavior of Commodities and their Investment Benefits | Inglês | Iscte | 2013 |
| 50 | Catarina Filipa Lopes Ramos | Measuring Perceived Service Quality at Portuguese Helthcare Centres: The moderating effect of outsourcing a core activity | Inglês | Iscte | 2012 |
| 51 | Ana Cristina dos Santos Oliveira | Avaliação Da Qualidade Percebida Dos Serviços Académicos De Uma Universidade Portuguesa | Português | Iscte | 2012 |
| 52 | Gustavo de Souza Barros | Variable Volatility in Option Pricing | Inglês | Iscte | 2012 |

• **Projetos Finais de Mestrado**
- Terminadas

| | Nome do Estudante | Título/Tópico | Língua | Instituição | Ano de Conclusão |
|----|--|--|---------------|--------------------|-------------------------|
| 1 | Gonçalo Amaral de Campos Pereira | Avaliação de Empresa: Shell plc | Inglês | Iscte | 2025 |
| 2 | Lamberto Lorini Sgariboldi | Avaliação do Desenvolvimento de um Novo Medicamento: VIR-7831 Case Study | Inglês | Iscte | 2021 |
| 3 | Neuza Carina Pires dos Santos | Linha ferroviária de alta velocidade entre Lisboa e Madrid: sim ou não? A perspetiva de opções reais | Inglês | Iscte | 2019 |
| 4 | João Pereira Pedro de Jesus | Oferta Pública de Aquisição do CaixaBank sobre o BPI: O Impacto na Ação do BPI | Inglês | Iscte | 2018 |
| 5 | Diogo Correia Rino | Costly Reversible Disinvestment Option in a Valuation of Renewable Energy case | Inglês | Iscte | 2017 |
| 6 | João Luís Navarro de Castro Correia Botelho | Avaliação de Empresas através de Múltiplos de Mercado - O caso da REN | Português | Iscte | 2017 |
| 7 | Ana Clara de Matos Soares Pereira Jacinto Talefe | Estudo sobre a Eficiência das Carteiras de Investimentos das Seguradoras Vida em Portugal | Português | Iscte | 2016 |
| 8 | João Pedro Robalo Martins | European Inflation-Linked Bonds: An historical overview and the benefits Amid Portfolio Management | Inglês | Iscte | 2015 |
| 9 | Miguel Seixas do Val Ferreira | Decomposition of a Financial Structured Product "Lloyds double up | Inglês | Iscte | 2014 |
| 10 | Carolina Albardeiro Santana | Modelos de Risco de Crédito: Análise de Telecoms Europeias e Bancos Americanos | Português | Iscte | 2014 |
| 11 | Mário António Limede | Modelos de Avaliação de Risco de Crédito - Análise e Aplicação | Português | Iscte | 2013 |
| 12 | Pedro Marzagão Barbuto | LSMC for Pricing American Options under the Heston Model | Inglês | Iscte | 2013 |
| 13 | Paulo Fernando Marques Ferreira | Evaluating Investment Opportunities under Different Model Dynamics: Some Managerial Insights | Inglês | Iscte | 2012 |
| 14 | João de Andrade Dias da Costa | Carbon Markets and Emission Derivatives - pricing of derivatives in the EU ETS | Inglês | Iscte | 2012 |
| 15 | Carla Alexandra Botas Prates | Pricing and Hedging Volatility Options. | -- | Iscte | 2011 |
| 16 | Jorge Manuel Duque de Oliveira | Pricing Corporate Debt Risk Under The Cev Model. | Inglês | Iscte | 2011 |

Total de Citações

| | |
|-----------------|-----|
| Web of Science® | 285 |
| Scopus | 228 |

Publicações

• Revistas Científicas

- Artigo em revista científica

| | |
|---|--|
| 1 | 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. Omega. 143 |
| 2 | Reis, J. M. & Dias, J. C. (2026). Dynamic debt with intensity-based models. Journal of Futures Markets. 46 (2), 334-352 |
| 3 | Taborda, B., Almeida, A. M. de., Dias, J. C., Batista, F. & Ribeiro, R. (2025). SA-MAIS: Hybrid automatic sentiment analyser for stock market. Journal of Information Science. 51 (6), 1443-1456 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 2 |
| 4 | 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 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 8 |
| 5 | 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 - N.º de citações Web of Science®: 3 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 5 |
| 6 | 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. Journal of Futures Markets. 44 (12), 1869-1887 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 3 |
| 7 | Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. (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 Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 6 |
| 8 | 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. Review of Derivatives Research. 27 (3), 227-258 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 1 |

| | |
|----|---|
| 9 | <p>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. <i>Economic Analysis and Policy</i>. 78, 1046-1058</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 3</p> |
| 10 | <p>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. <i>Journal of Banking Regulation</i>. N/A</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 9</p> <p>- N.º de citações Scopus: 7</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 11</p> |
| 11 | <p>Dutra, T. M., Teixeira, J. C. A. & Dias, J. C. (2023). Banking regulation and banks' risk-taking behavior: The role of investors' protection. <i>The Quarterly Review of Economics and Finance</i>. 90, 124-148</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 13</p> <p>- N.º de citações Scopus: 12</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 18</p> |
| 12 | <p>Kravchenko, I., Kravchenko, V. V., Torba, S. M. & 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 Web of Science®: 1</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 8</p> |
| 13 | <p>Larguinho, M., Dias, J. C. & 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®: 2</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 2</p> |
| 14 | <p>Proença, C., Neves, M., Dias, J. C. & 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®: 9</p> <p>- N.º de citações Scopus: 4</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 17</p> |
| 15 | <p>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. <i>International Review of Economics and Finance</i>. 79, 599-630</p> <p>- N.º de citações Web of Science®: 7</p> <p>- N.º de citações Scopus: 6</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 13</p> |
| 16 | <p>Fernandes, M. C, Dias, J. C. & 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®: 15</p> <p>- N.º de citações Scopus: 16</p> <p>- N.º de citações Google Scholar: 20</p> |
| 17 | <p>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</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: 6</p> |

| | |
|----|--|
| 18 | <p>Cruz, A. & 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> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 5 - N.º de citações Google Scholar: 10 |
| 19 | <p>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</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 11 - N.º de citações Scopus: 9 - N.º de citações Google Scholar: 15 |
| 20 | <p>Dias, J. C., Nunes, J. & 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> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 9 - N.º de citações Scopus: 7 - N.º de citações Google Scholar: 13 |
| 21 | <p>Kravchenko, I., Kravchenko, V. V., Torba, S. M. & 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> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 3 |
| 22 | <p>Dias, J. C. & Nunes, J. P. V. (2018). Universal recurrence algorithm for computing Nuttall, generalized Marcum and incomplete Toronto functions and moments of a noncentral x_2 random variable. <i>European Journal of Operational Research</i> . 265 (2), 559-570</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 6 |
| 23 | <p>Cruz, A. & 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"> - N.º de citações Web of Science®: 7 - N.º de citações Scopus: 5 - N.º de citações Google Scholar: 7 |
| 24 | <p>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</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 2 |
| 25 | <p>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</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 21 - N.º de citações Scopus: 14 - N.º de citações Google Scholar: 24 |
| 26 | <p>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</p> <ul style="list-style-type: none"> - N.º de citações Web of Science®: 23 - N.º de citações Scopus: 15 - N.º de citações Google Scholar: 24 |

| | |
|----|---|
| 27 | 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®: 31 - N.º de citações Scopus: 20 - N.º de citações Google Scholar: 36 |
| 28 | Larguinho, M., Dias, J. C. & Braumann, C. A. (2013). On the computation of option prices and Greeks under the CEV Model. <i>Quantitative Finance</i> . 13 (6), 907-917 - N.º de citações Web of Science®: 37 - N.º de citações Scopus: 31 - N.º de citações Google Scholar: 53 |
| 29 | Dias, J. C. & Nunes, J. P. (2011). Pricing real options under the constant elasticity of variance diffusion. <i>Journal of Futures Markets</i> . 31 (3), 230-250 - N.º de citações Web of Science®: 38 - N.º de citações Scopus: 31 - N.º de citações Google Scholar: 54 |
| 30 | Dias, J. C. & Shackleton, M. B. (2011). Hysteresis effects under CIR interest rates. <i>European Journal of Operational Research</i> . 211 (3), 594-600 - N.º de citações Web of Science®: 21 - N.º de citações Scopus: 18 - N.º de citações Google Scholar: 27 |
| 31 | Dias, J. C. & Shackleton, M. B. (2009). Durable vs. disposable equipment choice under interest rate uncertainty. <i>European Journal of Finance</i> . 15 (2), 157-167 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 3 - N.º de citações Google Scholar: 5 |

• Livros e Capítulos de Livros

- Autor de livro

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

- Editor de livro

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

- Capítulo de livro

| | |
|---|--|
| 1 | Dias, J. C., Larguinho, M. & 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. - N.º de citações Google Scholar: 1 |
| 2 | Dias, J. C. & 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. |

| | |
|---|---|
| 3 | Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2012). A Note on (Dis)Investment Options and Perpetuities under CIR Interest Rates. In Recent Developments in Modeling and Applications in Statistics, Studies in Theoretical and Applied Statistics. (pp. 203-211).: Springer. - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 1 |
| 4 | Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2012). Absolute Diffusion Process: Sensitivity Measures. In Advances in Regression, Survival Analysis, Extreme Values, Markov Processes and Other Statistical Applications, Studies in Theoretical and Applied Statistics. (pp. 233-241).: Springer. - N.º de citações Google Scholar: 1 |

• Conferências/Workshops e Comunicações

- Comunicação em evento científico

| | |
|----|---|
| 1 | Gaspar, L., Laureano, L., Fernandes, M. C & Dias, J. C. (2025). Modeling the Stochastic Volatility Behavior of Emission Allowances Prices: Evidence from the European Carbon Market Phases. Financial Economics Meeting (FEM 2025). |
| 2 | Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2025). Unpuzzling Volatility Risk Premiums through the Joint SPX/VIX Smile Calibration. Workshop on Financial Risk with Big Data. |
| 3 | 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. |
| 4 | Barbosa, L., Dias, J. C. & Marques, M. (2024). Subsidies and Sustainable Tourism: Balancing Demand Guarantees With Environmental Damage From Tourism. The 27th Annual International Real Options Conference . |
| 5 | 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). |
| 6 | 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. Scandinavian Actuarial Conference 2024. |
| 7 | Dias, J. C. (2023). Caps, Floors and Collars Contractual Agreements and Optimal Investment Decisions. 1st SDE - Stochastic Days Encounters: Applications of Stochastic Differential Equations. |
| 8 | 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. |
| 9 | 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. |
| 10 | 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. |
| 11 | Reis, J. & Dias, J. C. (2022). Dynamic Debt with Intensity Based Models. 29th Annual Global Finance Conference. |

| | |
|----|---|
| 12 | 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. |
| 13 | Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2022). Modeling Energy Futures Prices Under Alternative Time-Varying Volatility Dynamics. 29th Annual Global Finance Conference. |
| 14 | 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 |
| 15 | 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. |
| 16 | Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. Informs Annual Meeting. |
| 17 | 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. |
| 18 | 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. |
| 19 | 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. |
| 20 | 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. |
| 21 | 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. |
| 22 | 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. |
| 23 | 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. |
| 24 | 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. |
| 25 | Dias, J. C. (2019). A Note on the Loss of the Martingale Property under the CEV Process. XXIV Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística. |
| 26 | 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. |
| 27 | Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 12th Workshop on Statistics, Mathematics and Computation. |
| 28 | Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network. |

| | |
|----|---|
| 29 | 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. |
| 30 | 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 |
| 31 | 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. |
| 32 | 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. |
| 33 | 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: 5 |
| 34 | 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. |
| 35 | 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. |
| 36 | Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística. |
| 37 | 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. |
| 38 | 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. |
| 39 | Proença, C., Dias, J. C. & Neves, E. (2017). Determinants of Sovereign Debt Ratings: Effects of the Crisis. XVI Congresso Internacional de Contabilidade e Auditoria. |
| 40 | Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 2nd International Conference on Computational Finance. |
| 41 | Dias, J. C. & Nunes, J. (2016). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society. |
| 42 | Dias, J. C., Larginho, 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. |
| 43 | 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. |

| | |
|----|---|
| 44 | 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. |
| 45 | 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. |
| 46 | 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. |
| 47 | 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. |
| 48 | 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. |
| 49 | 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. |
| 50 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. Mathematical Finance Days Conference. |
| 51 | 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. |
| 52 | 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. |
| 53 | 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. |
| 54 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering. |
| 55 | 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. |
| 56 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Truncated Moments of a Noncentral χ^2 Random Variable: An Extension of the Benton and Krishnamoorthy Approach. XX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística. |
| 57 | 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. |
| 58 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 21st Annual Derivatives Securities and Risk Management Conference. |
| 59 | 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 |

| | |
|----|--|
| 60 | 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 |
| 61 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. International Conference on Mathematical Finance and Economics. |
| 62 | 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. |
| 63 | 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. |
| 64 | 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. |
| 65 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2010). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 6th World Congress of the Bachelier Finance Society. |
| 66 | 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. |
| 67 | Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2009). Processo Estocástico de Difusão Absoluta: Medidas de Sensibilidade. XVII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística. |
| 68 | Dias, J.C. & Shackleton, M. B (2009). Investment Hysteresis and Hitting Time for Mean-Reverting CIR Diffusions. 13th International Conference on Real Options. |
| 69 | Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 12th International Conference on Real Options. |
| 70 | 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

Director (2026 - 2029)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças

Director (2022 - 2026)
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Presidente (2022 - 2026)
Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2022 - 2026)
Unidade/Área: Comissão Científica

Membro (Docente) (2021 - 2023)
Unidade/Área: Comissão Permanente do Conselho Científico

Vice-Presidente (2021 - 2023)
Unidade/Área: Conselho Científico

Membro (Docente) (2021 - 2023)
Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Director (2021 - 2022)
Unidade/Área: Doutoramento em 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: Doutoramento em 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: Doutoramento em Finanças

Director (2015 - 2017)
Unidade/Área: Doutoramento em Finanças

Director (2015)
Unidade/Área: Mestrado em 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: Mestrado em Finanças

Actividades de Edição/Revisão Científica

| Tipo de Actividade | Título da Revista | ISSN/Quartil | Período | Língua |
|---------------------------------------|----------------------------------|--------------|------------|--------|
| Editor de revista científica | Review of Derivatives Research | | Desde 2025 | Inglês |
| Membro de equipa editorial de revista | Coimbra Business Review | | -- | Inglês |
| Membro de equipa editorial de revista | Journal of Finance and Economics | | -- | Inglês |