

**Aviso:** [2019-09-15 06:27] 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

### **Professor Associado (com Agregação)**

Departamento de Finanças (IBS)

### **Investigador Integrado**

UNIDE-IUL - Unidade de Investigação em Desenvolvimento Empresarial (IBS)  
[Finance Group]

## Contactos

### **E-mail**

Jose.Carlos.Dias@iscte-iul.pt

### **Gabinete**

D5.37

### **Telefone**

217650531 (Ext: 221229)

## Currículo

José Carlos Dias holds a PhD degree in Finance from ISCTE-IUL Business School. He is currently Associate Professor in Finance (with Agregação) at the Department of Finance and Director of the PhD in Finance at ISCTE-IUL Business School. He was also the Director of the Master in Finance at ISCTE-IUL Business School. His current research interests include option pricing, structured products and exotic options, 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.

## Áreas de Investigação

Option pricing

Structured products and exotic options

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

## Unidades Curriculares Lecionadas (no ano lectivo corrente)

Ano Letivo	Semestre	Nome da Unidade Curricular	Coordenador
2019/2020	1º	Finanças em Tempo Contínuo	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	Sim
2019/2020	1º	Projeto de Investigação em Finanças (6 Ects)	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	Sim
2019/2020	2º	Tese em Finanças (150 Ects)	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

## Orientações

### • Dissertações de Mestrado

- Em curso

Tipo de	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Estado	Instituição
---------	-------------------	--------	--------	--------	-------------

	Orientação					
1	Orientador	Martim da Penha Gonçalves Abecasis Burnay	Modelo de Scoring para PME's: Quais os principais indicadores a serem considerados para concessão de crédito e ocorrência de default?	--	Em curso	ISCTE-IUL
2	Orientador	Francisco Vitor Rebelo Rodrigues	The Pricing of Leverage Products	--	Em curso	ISCTE-IUL
3	Orientador	Rita de Sousa Ramalho	Modelos de Spread de Crédito com Volatilidade não Constante	--	Em curso	ISCTE-IUL
4	Orientador	Joana Isabel Tomás Ventura	Proponho-me a analisar o fair value de um produto: Credit Linked Notes (CLN) no mercado português. Irei também apresentar a evolução do mercado português dos produtos estruturados, evidenciando qual foi o impacto da regulamentação implementada em 2007 pela CMVM.	--	Em curso	ISCTE-IUL
5	Orientador	Hugo António Figueiredo Matias	Derivados Voláteis	--	Em curso	ISCTE-IUL
6	Orientador	João Seguro Ildefonso	Repeated Richardson Extrapolation and Static Hedging of Barrier Options	--	Em curso	ISCTE-IUL
7	Orientador	Tiago André Marques Coelho	Loss Given Default - Análise e avaliação a uma carteira de crédito - O caso português	Português	Em curso	ISCTE-IUL
8	Orientador	Neuza Carina Pires dos Santos	LINHA FERROVIÁRIA DE ALTA VELOCIDADE ENTRE LISBOA E MADRID, SIM OU NÃO? A PERSPECTIVA DE OPÇÕES REAIS	--	Em curso	ISCTE-IUL

#### - Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Orientador	Carlos Sérgio Serrado Ramos Ricardo	Construção do Novo Edifício Sede do Município de Oeiras. Análise de viabilidade económico-financeira	Português	ISCTE-IUL	2018
2	Orientador	Inês Pereira Santos	Modelos estruturais de risco de crédito: análise de empresas cotadas em Portugal	Inglês	ISCTE-IUL	2018

3	Orientador	Vitor Hugo Ferreira Pinto	Performance empírica de três modelos de precificação de opções	Inglês	ISCTE-IUL	2018
4	Orientador	Catarina da Silva Ferro Costa Pereira	Testing High Volatility Expectation Trades on Macroeconomic and Political Events of 2016	Inglês	ISCTE-IUL	2017
5	Orientador	André Gonçalo Lopes Fernandes	Structured Products Insights: Pricing reverse convertibles and discount certificates in the german market	Inglês	ISCTE-IUL	2017
6	Orientador	Mário Raul Santiago do Céu	Análise da Evolução do Risco de Crédito na Agricultura em Portugal	Português	ISCTE-IUL	2017
7	Orientador	Pedro Filipe Botelho Negrão de Sousa	Algorithms for Improving the Efficiency of CEV, CIR and JDCEV Option Pricing Models	Inglês	ISCTE-IUL	2017
8	Orientador	Marcelo Bettencourt Santos Nunes Capitão	Análise das Metodologias de Seleção de Projetos de Investimentos das PME	Português	ISCTE-IUL	2016
9	Orientador	Qi Dong	Credit Risk Measurement of the Listed Companies in China Based on Kmv Model	Inglês	ISCTE-IUL	2016
10	Orientador	Svetlana Klimova	Real Options Valuation - Investment Under New Technological Adoption and Carbon Policy Uncertain: An application to Volkswagen automobile industry	Inglês	ISCTE-IUL	2016
11	Orientador	João Miguel Mendes Carrilho	Stock Market Returns and Football Match Results	Inglês	ISCTE-IUL	2015
12	Orientador	Vincent Jean Maurice Mouralis	Commodity Futures in Portfolio Allocation	Inglês	ISCTE-IUL	2015
13	Orientador	Antoine Hugo Mairal	Equity-Linked Structured Products: A complex Industry in evolution	Inglês	ISCTE-IUL	2015
14	Orientador	Sara Maria Correia Pereira	Pricing of a Credit Default Swap	Inglês	ISCTE-IUL	2015
15	Orientador	Carlos António Fernandes Casimiro	Structural Models in Credit Risk	Inglês	ISCTE-IUL	2015
16	Orientador	Filipe Luís Abraúl Rosa Gonçalves Pereira	The Kim(1990) American Options Valuation Method: A comparative analysis	Inglês	ISCTE-IUL	2014
17	Co-Orientador	Marcelo Gomes Raposo dos Santos Pereira	The Cyclical Behavior of Commodities and their Investment Benefits	Inglês	ISCTE-IUL	2013
18	Co-Orientador	João Pedro Bento Ruas	Three Essays on the valuation of American-style options	Inglês	ISCTE-IUL	2013

19	Orientador	Catarina Filipa Lopes Ramos	Measuring Perceived Service Quality at Portuguese Healthcare Centres: The moderating effect of outsourcing a core activity	Inglês	ISCTE-IUL	2012
20	Co-Orientador	Ana Cristina dos Santos Oliveira	Avaliação Da Qualidade Percebida Dos Serviços Académicos De Uma Universidade Portuguesa	Português	ISCTE-IUL	2012
21	Orientador	Gustavo de Souza Barros	Variable Volatility in Option Pricing	Inglês	ISCTE-IUL	2012

## • Projetos Finais de Mestrado

### - Terminadas

	Tipo de Orientação	Nome do Estudante	Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Orientador	João Pereira Pedro de Jesus	Oferta Pública de Aquisição do CaixaBank sobre o BPI: O Impacto na Ação do BPI	Inglês	ISCTE-IUL	2018
2	Orientador	Diogo Correia Rino	Costly Reversible Disinvestment Option in a Valuation of Renewable Energy case	Inglês	ISCTE-IUL	2017
3	Orientador	João Luís Navarro de Castro Correia Botelho	Avaliação de Empresas através de Múltiplos de Mercado - O caso da REN	Português	ISCTE-IUL	2017
4	Orientador	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
5	Orientador	João Pedro Robalo Martins	European Inflation-Linked Bonds: An historical overview and the benefits Amid Portfolio Management	Inglês	ISCTE-IUL	2015
6	Orientador	Miguel Seixas do Val Ferreira	Decomposition of a Financial Structured Product "Lloyds double up	Inglês	ISCTE-IUL	2014
7	Orientador	Carolina Albardeiro Santana	Modelos de Risco de Crédito: Análise de Telecoms Europeias e Bancos Americanos	Português	ISCTE-IUL	2014
8	Orientador	Mário António Limede	Modelos de Avaliação de Risco de Crédito - Análise e Aplicação	Português	ISCTE-IUL	2013
9	Orientador	Pedro Marzagão Barbuto	LSMC for Pricing American Options under the Heston Model	Inglês	ISCTE-IUL	2013
10	Orientador	João de Andrade Dias da Costa	Carbon Markets and Emission Derivatives - pricing of derivatives in the EU ETS	Inglês	ISCTE-IUL	2012

11	Orientador	Paulo Fernando Marques Ferreira	Evaluating Investment Opportunities under Different Model Dynamics: Some Managerial Insights	Inglês	ISCTE-IUL	2012
12	Orientador	Carla Alexandra Botas Prates	Pricing and Hedging Volatility Options.	--	ISCTE-IUL	2011
13	Orientador	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>	54
<b>Scopus</b>	71

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	Cruz, A. & Dias, J. C. (2019). Valuing American-style options under the CEV model: an integral representation based method. <i>Review of Derivatives Research</i> . 1-21
2	Nunes, J. P. V., Dias, J. C. & Ruas, J. P. (2018). The early exercise boundary under the jump to default extended CEV model. <i>Applied Mathematics and Optimization</i> . NA - N.º de citações Scopus: 2
3	Dias, J. C. & Nunes, J. P. V. (2017). 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
4	Cruz, A. & Dias, J. C. (2017). The binomial CEV model and the Greeks. <i>Journal of Futures Markets</i> . 37 (1), 90-104 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 2
5	Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. & Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. <i>Journal of Derivatives</i> . 23 (4), 20-32 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 1
6	Dias, J. C., Nunes, J. P. V. & Ruas, J. P. (2015). Pricing and static hedging of european-style double barrier options under the jump to default extended CEV model. <i>Quantitative Finance</i> . 15 (12), 1995-2010 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 6
7	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2015). Pricing and static hedging of American-style knock-in options on defaultable stocks. <i>Journal of Banking and Finance</i> . 58, 343-360 - N.º de citações Web of Science®: 4 - N.º de citações Scopus: 6

8	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®: 13 - N.º de citações Scopus: 15
9	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®: 9 - N.º de citações Scopus: 10
10	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®: 5 - N.º de citações Scopus: 8
11	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®: 15 - N.º de citações Scopus: 18
12	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: 2

## • Livros e Capítulos de Livros

### - Autor de livro

1	Dias, J. C. (2014). <i>Hysteresis: Types, Applications and Behavior Patterns in Complex Systems</i> .
---	---

### - 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.
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). 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.

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 Recent Developments in Modeling and Applications in Statistics, Studies in Theoretical and Applied Statistics. (pp. 203-211): Springer.</p> <p>- N.º de citações Scopus: 1</p>
---	--

## • Conferências/Workshops e Comunicações

### - Comunicação em evento científico

1	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network.
2	Ruas, J., Nunes, J. & Dias, J. C. (2018). Early Exercise Boundaries for American-style Knock-Out Options. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society.
3	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.
4	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.
5	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.
6	Dias, J. C., Larguinho, 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.
7	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 12th Workshop on Statistics, Mathematics and Computation.
8	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.
9	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.
10	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
11	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.
12	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.
13	Proença, C., Dias, J. C. & Neves, E. (2017). Determinants of Sovereign Debt Ratings: Effects of the Crisis. XVI Congresso Internacional de Contabilidade e Auditoria.



14	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 2nd International Conference on Computational Finance.
15	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.
16	Dias, J. C. & Nunes, J. (2016). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
17	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.
18	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.
19	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.
20	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.
21	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.
22	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.
23	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.
24	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.
25	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.
26	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. Mathematical Finance Days Conference.
27	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.
28	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.
29	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.
30	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering.

31	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.
32	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.
33	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. International Conference on Mathematical Finance and Economics.
34	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.
35	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.
36	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 21st Annual Derivatives Securities and Risk Management Conference.
37	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.
38	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.
39	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2010). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 6th World Congress of the Bachelier Finance Society.
40	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.
41	Dias, J.C., Larguinho, M. & Braumann, C.A. (2009). Processo Estocástico de Difusão Absoluta: Medidas de Sensibilidade. XVII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
42	Dias, J.C. & Shackleton, M. B (2009). Investment Hysteresis and Hitting Time for Mean-Reverting CIR Diffusions. 13th International Conference on Real Options.
43	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 12th International Conference on Real Options.
44	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	Dias, J. C. (2018). Avaliação de opções standard e barreira com o modelo CEV. Boletim da Sociedade Portuguesa de Estatística. Outono, 49-56
---	---

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

## Cargos de Gestão Académica

Coordenador da unidade curricular Tese em Finanças (150 Ects) (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Tese em Finanças III (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Opções Reais (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Tese em Finanças I (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos I (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças I (2020)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Finanças em Tempo Contínuo (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Projeto de Investigação em Finanças (6 Ects) (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Tese em Finanças II (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças II (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Membro da Comissão Permanente do Conselho Científico do ISCTE-IUL (2019 - 2021)  
Unidade/Área: Comissão Permanente do Conselho Científico

Membro do Plenário do Conselho Científico do ISCTE-IUL (2019 - 2021)  
Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Director do Doutoramento em Finanças (2019 - 2021)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos I (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Tese em Finanças (150 Ects) (2019)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças I (2019)  
Unidade/Área: Finanças

<p>Coordenador da unidade curricular Opções Reais (2019) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Membro da Comissão Permanente da Comissão Científica do Departamento de Finanças (2018 - 2022) Unidade/Área: Comissão Científica</p>
<p>Membro da Comissão Científica da Unidade de Investigação UNIDE-IUL (2018 - 2022) Unidade/Área: Comissão Científica</p>
<p>Membro do Plenário da Comissão Científica da Escola de Gestão (2018 - 2022) Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças II (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Projeto de Investigação em Finanças (6 Ects) (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Finanças Empresariais Avançadas (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Opções Reais (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças I (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos I (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (Pg) (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (2018) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Finanças Empresariais Avançadas (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças II (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos II (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Projeto de Investigação em Finanças (6 Ects) (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos I (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Produtos Financeiros Derivados (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Director do Doutoramento em Finanças (2017 - 2019) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Investimentos e Opções Reais (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (Pg) (2017) Unidade/Área: Finanças</p>

<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Opções Reais (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Seminário de Investigação em Finanças I (2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (Pg) (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Investimentos e Opções Reais (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos II (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Finanças da Empresa II (3ºciclo) (2016) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos I (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Seminário de Especialização em Finanças I (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Director do Doutoramento em Finanças (2015 - 2017) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Finanças da Empresa II (3ºciclo) (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos II (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (Pg) (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Dissertação em Finanças (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Investimentos e Opções Reais (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Risco de Crédito (2015) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Membro da Comissão Científica da Unidade de Investigação UNIDE-IUL (2014 - 2018) Unidade/Área: Comissão Científica</p>
<p>Membro da Comissão Permanente da Comissão Científica do Departamento de Finanças (2014 - 2018) Unidade/Área: Comissão Científica</p>
<p>Membro do Plenário da Comissão Científica da Escola de Gestão (2014 - 2018) Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Trabalho de Projecto em Finanças (2014) Unidade/Área: Finanças</p>
<p>Coordenador da unidade curricular Avaliação Económico-Financeira de Empresas (2014) Unidade/Área: Finanças</p>

Coordenador da unidade curricular Introdução às Finanças Computacionais (2014)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Futuros e Opções (Opt) (2014)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Dissertação em Finanças (2014)  
Unidade/Área: Finanças

Coordenador da unidade curricular Gestão Financeira de Empresas e Projectos I (2014)  
Unidade/Área: Finanças