Firmante: Universidade da Coruña - Q6550005J URL de validación: https://sede.udc.gal/services/documents_validation CSV: B6FUJ9DAR4M0BJURG52TTURQ
Este documento es copia auténtica de un documento custodiado por la Universidad de A Coruña. Fecha de creación: 26/05/2015 13:56:29 Página 1 de un total de 3 página(s).

UNIVERSIDADE DA CORUÑA

XUNTA DE GALICIA
CONSELLERÍA DE CULTURA, EDUCACIÓN E ORDENACIÓN UNIVERSITARIA

ANEXO III

REF.: 2015/CP/069

MODELO DE CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

AXUDA

Referencia: GRC2014/044

Título: : Axudas para a consolidación e estruturación de unidades de investigación competitivas do Sistema universitario de Galicia. Modalidade de grupos de referencia competitiva. Convocatoria 2014

CENTRO: Facultade de Informática

OBXECTO DO CONTRATO: Colaborador/a nas tarefas do proxecto de investigación que se indica.

LUGAR E HORARIO: Facultade de Informática, 09:00 a 14:00 e 15:00 a 17:30 horas, de luns a venres

GRUPO DE COTIZACIÓN NO RÉXIME XERAL DA SEGURIDADE SOCIAL: Grupo I

CATEGORÍA PROFESIONAL (ACORDO DO 17 DE NOVEMBRO DE 2014 SOBRE O PERSOAL CONTRATADO CON CARGO AO CAPÍTULO VI DOS ORZAMENTOS DA UDC)

Investigador asociado ☒ Investigador en formación ☐

Técnico de apoio á investigación ☐ Axudante de apoio á investigación ☐

Técnico administrativo ☐ Axudante administrativo ☐

XORNADA	Tempo Completo: ☒	Tempo Parcial: ☐	
DURACIÓN	3 meses e 16 días	DATA APROX. DE INICIO	16/07/2015

RETRIBUCIÓNS BRUTAS : 2.000,00 €/mes (incluido prorrateo pagas extras)

PARTIDA ORZAMENTARIA: 61.40 242415 541A 6490200

* O pagamento da retribución realizarase en 12 mensualidades (inclúese en cada mensualidade a parte proporcional de paga extraordinaria correspondente)

REQUISITOS

TITULACIÓN: Doutor/a en Matemáticas

EXPERIENCIA: Formación doctoral no ámbito da matemática financieira. Experiencia investigadora nos modelos de mercado de LIBOR para tipos de xuro, a nivel de modelado e simulación numérica, avalada fundamentalmente por publicación científicas en revistas indexadas no JCR

LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES E DOCUMENTACIÓN

LUGAR: por correo electrónico a yparajo@udc.es

PRAZO: 10 días desde a publicación desta convocatoria no taboleiro da sede electrónica da UDC

CRITERIOS E ÓRGANO DE SELECCIÓN

CRITERIOS: Valoración do currículo e posibilidade de entrevista persoal. Na memoria anexa detállase o desglose das puntuacións dos distintos aspectos a valorar.

ORGANO: : Carlos Vázquez Cendón (Investigador Principal do proxecto)

A Coruña, 22 de maio de 2015

O INVESTIGADOR PRINCIPAL

Asdo.: Carlos Vázquez Cendón

Documentación que debe presentar o solicitante:

1. Fotocopia D.N.I.
2. Fotocopia da titulación académica.
3. Curriculum vitae.

Firmante: Universidade da Coruña - Q6550005J URL de validación: https://sede.udc.gal/services/documents_validation CSV: B6FUJ9DAR4M0BJURG52TTURQ
Este documento es copia auténtica de un documento custodiado por la Universidad de A Coruña. Fecha de creación: 26/05/2015 13:56:29 Página 2 de un total de 3 página(s).

UNIVERSIDADE DA CORUÑA

XUNTA DE GALICIA
CONSELLERÍA DE CULTURA, EDUCACIÓN E ORDENACIÓN UNIVERSITARIA

MEMORIA DA CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

DATOS DO PROXECTO

Título: Axudas para a consolidación e estruturación de unidades de investigación competitivas do Sistema universitario de Galicia. Modalidade de grupos de referencia competitiva. Convocatoria 2014
Referencia: GRC2014/044
Investigador Principal: Carlos Vázquez Cendón

DETALLES DA CONVOCATORIA

Tarefas a realizar:

- Revisión de modelos de mercado del LIBOR (LMM) multicurva para derivados financieiros de tipos de xuro.
- Proposta de novos modelos.
- Revisión de modelos de mercado del LIBOR (LMM) dunha curva para expresalos usando "real world probability" en lugar de "risk neutral".
- Implementación de métodos de simulación dos modelos en ordenador.
- Calibración e axuste dos parámetros dos modelos con datos de mercado.

Xustificación da duración do contrato: O tempo estimado para desenvolver este traballo é de 3,5 meses, e comprenderá as seguintes etapas:

- Estudio e desenvolvemento de modelos de LIBOR multicurva para derivados financieiros de tipos de xuro
- Estudio e desenvolvemento de modelos de LIBOR dunha curva en "real world probability" para a súa aplicación en carteiras de seguros. Simulación e calibración dos modelos.

Requisitos dos candidatos:

- Formación doctoral no ámbito da matemática financieira.
- Experiencia investigadora nos modelos de mercado de LIBOR para tipos de xuro, a nivel de modelado e simulación numérica, avalada fundamentalmente por publicación científicas en revistas indexadas no JCR

Criterios e valoración de méritos:

Concepto	Puntuación	Máximo
Máster con formación afín as tarefas a desenvolver (Enxeñería Matemática, Matemática Industrial, etc)		4
Experiencia predoctoral en tarefas de investigación relacionadas coas tarefas a realizar	0,25 Puntos x mes traballado	20 puntos
Experiencia posdoctoral en tarefas de investigación relacionadas coas tarefas a realizar	0.5 Puntos x mes traballado	15 puntos
Publicacións científicas relacionadas coas tarefas a realizar	- 4 Puntos x publicación en revistas do JCR - 1 Punto x capítulo de libro ou acta de congresos	20 puntos
Traballos presentados en congresos relacionados coas tarefas a realizar	0,5 Puntos x traballo presentado en Congreso	10 puntos
Posibilidade de entrevista persoal aos candidatos con máis puntuación		20 puntos

Documentación que debe presentar o solicitante:

1. Fotocopia D.N.I.
2. Fotocopia da titulación académica.
3. Curriculum vitae.

Documentación que debe presentar o solicitante:

- Instancia de solicitude indicando a referencia desta convocatoria que figura na publicación da sede electrónica da UDC
- Fotocopia do DNI
- Fotocopia do título de doutor
- Curriculum vitae

Lugar de presentación: Por correo electrónico a yparajo@udc.es
Prazo de presentación: 10 días desde a publicación da convocatoria no taboleiro da sede electrónica da UDC

Documentación que debe presentar o solicitante:

1. Fotocopia D.N.I.
2. Fotocopia da titulación académica.
3. Curriculum vitae.

Firmante: Universidade da Coruña - Q6550005J URL de validación: https://sede.udc.gal/services/documents_validation CSV: B6FUJ9DAR4M0BJURG52TTURQ
Este documento es copia auténtica de un documento custodiado por la Universidad de A Coruña. Fecha de creación: 26/05/2015 13:56:29 Página 3 de un total de 3 página(s).