

REF.: 2015/CP/101
ANEXO III
MODELO DE CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN
AXUDA

Referencia: PROYECTO WAKEUPCALL ITN-EID

Título: Novas aproximacións á cuantificación e a xestión do risco do modelo

CENTRO: Facultade de Informática

OBXECTO DO CONTRATO: Estudante de doutoramento para colaborar nas tarefas de investigación asociadas ao proxecto "WAKEUPCALL" no marco do programa H2020 EU Marie Curie Initial Training Network

LUGAR E HORARIO: Facultade de Informática / De luns a venres de 09:00 a 14:00 e de 15:30 a 18:00

GRUPO DE COTIZACIÓN NO RÉXIME XERAL DA SEGURIDADE SOCIAL: 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 anos **DATA APROX. DE INICIO** 01/10/2015

RETRIBUCIÓN BRUTAS: 2.681,16 €/mes

PARTIDA ORZAMENTARIA: 6140280074541A6490200

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

REQUISITOS
TITULACIÓN

1. Titulado superior en Matemáticas, Matemática aplicada ou Matemática financeira
2. Máster en Matemáticas, Matemática aplicada, Matemática financeira ou Matemática Industrial
3. Estar matriculado/a nun programa de doutoramento do SUG
4. Segundo a regulación de mobilidade do programa Marie Skłodowska Curie, o solicitante non pode ter vivido ou realizado ningunha actividade (traballos, estudos, etc) no país da institución contratante durante máis de 12 meses nos 3 anos inmediatamente anteriores

EXPERIENCIA: Ser, na data da contratación, un investigador na súa etapa inicial, i.e. no inicio da súa carreira investigadora e non estar en posesión de ningún título de doutor/a

OUTROS REQUISITOS:
LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES E DOCUMENTACIÓN
LUGAR: Enviar a documentación nun arquivo .zip a Carlos Vázquez (carlosv@udc.es)

PRAZO: Ata o 25 de agosto de 2015

CRITERIOS E ÓRGANO DE SELECCIÓN:
CRITERIOS:

- Expediente da titulación superior e do máster: 50%
- Publicacións: 10%
- Experiencia e formación previa relacionada co obxecto da investigación: 10%
- Nivel de inglés: 10%
- Entrevista estruturada en inglés: 20%

Órgano: Carlos Vázquez Cendón

A Coruña, 23 de xullo de 2015
VAZQUEZ
CENDON
CARLOS - DNI
34946083K

Firmado digitalmente por VAZQUEZ CENDON CARLOS - DNI 34946083K
Nombre de reconocimiento (DN): cn=VAZQUEZ CENDON CARLOS - DNI 34946083K, sn=VAZQUEZ CENDON, givenName=CARLOS, c=ES, o=UNIVERSIDAD DE A CORUÑA, ou=certificado electrónico de empleado público, MATEMATICAS, 16002, serialNumber=34946083K
Fecha: 2015.07.23 14:15:13 +0200'

Asdo: Carlos Vázquez Cendón, Investigador Principal

*Acordo sobre clasificación profesional, condicións de traballo e marco de referencia da representatividade laboral do persoal contratado con cargo a proxectos e convenios de I+D+I financiados a través do capítulo VI dos orzamentos da UDC. Asinado o 17/11/2014 entre a UDE e os sindicatos CCOO e CIG

MEMORIA DA CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

DATOS DO PROXECTO

Título: WAKEUP CALL (“Applied mathematics for risk measures in finance and insurance, in the wake of the crisis”)

Referencia: Grant Agreement no: 643045 in the MSCA-ITN-2014-EID:Marie Skłodowska-Curie Innovative Training Networks (ITN-EID)

Investigador principal: Carlos Vázquez Cendón

DETALLES DA CONVOCATORIA

Descrición do traballo:

A investigación levarase a cabo no marco do proxecto “WAKEUPCALL” financiado a través do programa H2020 EU Marie Curie Initial Training Network que proporcionará, a 6 investigadores na etapa inicial da súa carreira investigadora, unha oportunidade única para a súa iniciación nas investigación máis innovadoras no campo das finanzas computacionais e da xestión de riscos ao amparo do prestixioso programa Marie Curie European Industrial Doctorates (EID)

O obxectivo do proxecto WAKEUPCALL é alcanzar un profundo coñecemento dos aspectos relacionados coa xestión do risco financeiro e a teoría matemática de valoración dos derivados financeiros (e produtos relacionados). O estudante de doutoramento seleccionado será membro do equipo do proxecto WAKEUPCALL e participará nos diferentes eventos relacionados co proxecto que se celebren en Europa.

A colaboración coa industria é obligatoria nos proxectos do programa EID polo tanto, o candidato seleccionado, realizará unha estancia de 18 meses nunha das empresas asociadas a este proxecto. Concretamente, para esta convocatoria, a empresa asociada é o Banco Santander estando a súa sede central en Madrid, España. O Banco Santander é o maior banco da Eurozona e un dos máis importantes do mundo dando servizo a 100 millóns de clientes, 18300 empregados e unha facturación anual de 40 billóns. A súa principal actividade é a banca minorista. O Banco Santander está ademais moi involucrado na inversión en I+D. É de esperar que o estudante de doutoramento seleccionado colabore coa empresa asociada ao proxecto, Banco Santander, en calquera das etapas do desenvolvemento dos seus estudos de doutoramento e non unicamente durante a súa estadía obrigatoria nas oficinas do Banco Santander.

O grupo de investigación “M2NICA” (<http://dm.udc.es/m2nica/en>) da Universidade da Coruña recibirá ao candidato seleccionado. O grupo é experto en métodos e modelos matemáticos para a solución de problemas en enxeñaría e ciencias aplicadas, tamén desenvolve ferramentas informáticas para a simulación numérica de procesos e dispositivos. Unha das súas principais liñas de investigación e transferencia é a resolución de problemas reais que xurden no campo dos seguros e as finanzas.

O estudante de doutoramento seleccionado será supervisado, principalmente, polo profesor Carlos Vázquez Cendón e centrará a súa investigación no risco dos modelos financeiros, i.e. o risco relacionado coa selección de modelos estocásticos para as accións financeiras, tipos de xuro, tipos de cambio, etc. O risco de modelo pode ter graves consecuencias nas decisións bancarias polo uso incorrecto dos resultados ou informes dos modelos. O obxectivo principal é o deseño dun marco xeral e teórico para a xestión do risco de modelo. Descoidar a incerteza do modelo pode conducir a grandes perdas e/ou custos de reputación. O xestión do risco de modelo é una das áreas relativamente novas na xestión do risco e que está a recibir una crecente atención regulatoria. Os resultados publicaranse en revistas internacionais e presentaranse en conferencias en congresos, debendo conducir a unha tese de doutoramento no prazo de tres anos.

Duración do contrato:

A duración de 3 anos ven determinada pola vixencia do proxecto European ITN-EID WAKEUPCALL.

Requisitos dos candidatos:

1. Titulado superior en Matemáticas, Matemática aplicada ou Matemática financeira
2. Máster en Matemáticas, Matemática aplicada, Matemática financeira ou Matemática Industrial
3. Ser, na data da contratación, un investigador na súa etapa inicial, i.e. no inicio da súa carreira investigadora e non estar en posesión de ningún título de doutor/a
4. Segundo a regulación de mobilidade do programa Marie Skłodowska Curie, o solicitante non pode ter vivido ou realizado ningunha actividade (traballos, estudos, etc) no país da institución contratante durante máis de 12 meses nos 3 anos inmediatamente anteriores.
5. Estar matriculado/a nun programa de doutoramento do SUG

Critérios de avaliación:

- Expediente da titulación superior e do máster: 50%, mínimo en titulación superior 3 sobre 4, mínimo en máster 3,5 sobre 4
- Publicacións: 10%, publicacións en JCR 1 punto/publicación
- Experiencia e formación previa relacionada co obxecto da investigación: 10%, mínimo 6 meses experiencia ou título de máster adicional en tema afín, 1 punto por ano traballado, 2 puntos por título de máster afín
- Nivel de inglés: 10%, máxima puntuación con First certificate (B2) ou equivalente
- Entrevista estruturada en inglés: 20%
- A máxima puntuación total son 100 puntos

Documentación:

- Instancia de solicitude motivada
- CV detallado,
- Copia do pasaporte ou tarxeta de identificación,
- Expediente académico da titulación superior e do máster
- Listado de publicacións
- Xustificante de estar matriculado/a nun programa de doutoramento do SUG

Presentación da solicitude: Enviar a documentación nun arquivo .zip a Carlos Vázquez (carlosv@udc.es)

Prazo de solicitude: Ata o 25 de agosto de 2015

REF.: 2015/CP/101
ANNEXE III
FORM OF THE RECRUITMENT CALL
GRANT:

Reference: WAKEUPCALL ITN-EID PROJECT			
Title: New approaches to quantification and management of model risk			
University Center: Faculty of Informatics, University of A Coruña			
Motivation of the contract: Ph.D. position associated to the H2020 EU Marie Curie Initial Training Network project named "WAKEUPCALL"			
Place and timetable: Faculty of Informatics, 37 hours per week			
GROUP IN THE GENERAL REGIME OF SOCIAL SECURITY: I			
PROFESSIONAL LEVEL* (AGREEMENT 17 NOVEMBER 2014 ABOUT HIRED STAFF BELONGING TO CHAPTER VI DOF UDC BUDGET)			
Associated researcher <input type="checkbox"/>		Researcher in training <input checked="" type="checkbox"/>	
Technician to support research <input type="checkbox"/>		Assistant to support research <input type="checkbox"/>	
Administrative staff <input type="checkbox"/>		Administrative assistant <input type="checkbox"/>	
Dedication regime	Full time: <input checked="" type="checkbox"/>	Part time: <input type="checkbox"/>	
Position duration	3 years	Envisaged starting date	01 October 2015
GROSS SALARY : 2.681,16 €/month			
BUDGET ITEM: 6140280074541A6490200			

* Salary will be received through 12 monthly payments (the proportional part of the extraordinary payment is already included in each monthly payment)

REQUIREMENTS

1. Bachelor in Mathematics, Applied Mathematics or Financial Mathematics
2. Master in Mathematics, Applied Mathematics, Financial Mathematics or Industrial Mathematics
3. According to the rules of the position at UDC, at the deadline of the call the candidate has to be registered in a Ph.D. Program at any of the Galician Universities
4. According to the regulations for mobility within the Marie Skłodowska Curie programme, at the time of recruitment by the host organisation, the applicant must not have resided or carried out their main activity (work, studies, etc) in the country of their host organisation for more than 12 months in the 3 years immediately prior to the reference date.

EXPERIENCE: They have to be — at the date of recruitment — an 'early stage researcher' (ESR), i.e. starting his/her research career and not have a doctoral degree

OTHER REQUIREMENTS:

PRESENTATION OF CALL AND DOCUMENTS

CALL PROCEDURE: Send documentation in a .zip file to Carlos Vázquez (carlosv@udc.es)

DEADLINE: August, 25

SELECTION COMMISSION:
CRITERIA:

- Bachelor and Master transcripts: 50%
- Publications: 10%
- Previous experience and training related to the PhD subject: 10%
- English level: 10%
- Interview: 20%

Recruitment Committee: Carlos Vázquez Cendón

A Coruña, 23 of July of 2015

**VAZQUEZ
CENDON
CARLOS - DNI
34946083K**

Firmado digitalmente por VAZQUEZ
CENDON CARLOS - DNI 34946083K
Nombre de reconocimiento (DN):
cn=VAZQUEZ CENDON CARLOS -
DNI 34946083K, sn=VAZQUEZ
CENDON, givenName=CARLOS, o=ES,
ou=UNIVERSIDAD DE A CORUÑA,
ou=certificado electrónico de empleado
público, MATHEMATICAS, 16002,
serialNumber=34946083K
Fecha: 2015.07.23 14:16:34 +0200'

Signed: Carlos Vázquez Cendón, Main Researcher

SUMMARY OF THE RECRUITMENT CALL

PROJECT DATA

Title: WAKEUP CALL (“Applied mathematics for risk measures in finance and insurance, in the wake of the crisis”)

Reference: Grant Agreement no: 643045 in the MSCA-ITN-2014-EID:Marie Sklodowska-Curie Innovative Training Networks (ITN-EID)

Main researcher: Carlos Vázquez Cendón

CALL DETAILS

Job description:

The research will be carried out in the context of the H2020 EU Marie Curie Initial Training Network project named “WAKEUPCALL”, which will provide a unique opportunity, for 6 researchers in early stages of their careers, to study cutting-edge research topics in the field of computational finance and risk management, under the prestigious scheme of the Marie Curie European Industrial Doctorates (EID).

The aim of the WAKEUPCALL project is to deeper understand issues in financial risk management, and in the mathematical theory of pricing financial derivatives (and the related products). The PhD candidate will join the WAKEUPCALL community, and take part in the WAKEUPCALL events in Europe.

In an EID project a close cooperation with industry is mandatory, therefore a stay of 18 months with the industrial partner is expected and prescribed. For the current vacancy, the industrial partner is Banco Santander, headed in Madrid, Spain. Banco Santander is the largest bank in the Eurozone and one of the largest in the world, which currently serves to 100 million customers, 183000 employees and an annual turnover of 40 billion. The main business is the retail bank. Moreover, Banco de Santander is highly involved in R+D investment. It is expected that the PhD student will work closely together with the industrial partner, Banco Santander, at any stage of her/his PhD, and not only during the compulsory stay at the Banco Santander offices.

The research group "M2NICA"(<http://dm.udc.es/m2nica/en>) at University of A Coruña will host the PhD candidate. The group is expert on mathematical modeling and numerical solution of problems arising in engineering and different applied sciences, also developing computer toolboxes for the numerical simulation of process and devices. The treatment of real problems arising in insurance and finance is one of the main research and transfer lines.

The PhD student, mainly supervised by prof. Carlos Vázquez, will work on the use financial model risk, i.e. the risk related to the choice of stochastic model for assets, interest rates, FX, etc. Model risk has the potential of severe consequences of banking decisions based on incorrect or misused model outputs and reports. The main aim is the design of a general and theoretical framework for model risk management. Neglecting model uncertainty may lead to large losses and/or reputational costs. Model risk management is a relatively new area of risk management receiving a growing amount of regulatory scrutiny. Results are to be published in international journals and presented at major conferences and they must lead to a PhD thesis within 3 years.

Motivation of the call:

The 3 year ESR position belongs to the European ITN-EID WAKEUPCALL.

Candidates requirements:

1. Bachelor in Mathematics, Applied Mathematics or Financial Mathematics
2. Master in Mathematics, Applied Mathematics, Financial Mathematics or Industrial Mathematics
3. To be — at the date of recruitment — an ‘early stage researcher’ (ESR), i.e. starting his/her research career and not have a doctoral degree
4. According to the rules of the position at UDC, at the deadline of the call the candidate has to be registered in a Ph.D. Program at any of the Galician Universities
5. According to the regulations for mobility within the Marie Skłodowska Curie programme, at the time of recruitment by the host organisation, the applicant must not have resided or carried out their main activity (work, studies, etc) in the country of their host organisation for more than 12 months in the 3 years immediately prior to the reference date.

Valuation criteria:

- Bachelor and Master transcripts: 50%, minimum rates 3 out of 4 at bachelor, minimum rates 3,5 out of 4 at master level
- Publications: 10%, articles in JCR list 1 point per article
- Experience and training related to the PhD subject: 10%, minimum 6 months experience or additional master degree in related topic to position, 1 point per year of experience and 2 points per additional master degree
- English level: 10%, maximum rates correspond to First Certificate (B2) or equivalent
- Structured interview in English: 20%
- Maximum total points equal to 100.

Documents to be presented by candidates:

- A motivation letter asking for the position,
- A detailed CV,
- A copy of passport or ID card,
- A transcript of completed Bachelor and MSc courses
- A list of publications, if it is the case
- A certificate of being registered at a Ph.D. Program at any Galician University.

Submission of applications: Send documentation in a .zip file to Carlos Vázquez (carlosv@udc.es)

Deadline for applications: August, 25