

REF.:2016/CP/111
ANEXO III
MODELO DE CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN
AXUDA

Referencia: MTM2013-47800-C2-1-P			
Título: Modelado Matemático, Análisis y Simulación Numérica de Problemas en Finanzas y Seguros, Procesos Industriales, Biotecnología y Medioambiente			
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	6 meses	DATA APROX. DE INICIO	16/01/2017
RETRIBUCIÓN BRUTAS : 1706,25 €/mes (incluido prorrateo pagas extras)			
PARTIDA ORZAMENTARIA: 6140 210507 541A 6490200			

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

REQUISITOS

TITULACIÓN: Enxeñeiro Informático, Licenciado en Matemáticas ou grados equivalentes.
EXPERIENCIA: Formación predoutoral no ámbito da matemática financeira. Experiencia investigadora en modelado e simulación numérica en finanzas con ecuacións diferenciais estocásticas e en derivadas parciais, programación de métodos numéricos e paralelización con GPUs, avalada por publicación científica en revistas indexadas no JCR
OUTROS REQUISITOS: Mestrado en enxeñería matemática, matemática industrial ou equivalente. Os requisitos deben terse cumprido no momento de finalizar o prazo de presentación de solicitudes.

LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES E DOCUMENTACIÓN

LUGAR: por correo electrónico a carlosv@udc.es
PRAZO: 10 días desde a publicación desta convocatoria no taboleiro da sede electrónica da UDC

ÓRGANO DE SELECCIÓN E LUGAR DE PUBLICACIÓN DA RESOLUCIÓN

ORGANO: Carlos Vázquez Cendón (Investigador Principal do proxecto).
LUGAR DE PUBLICACIÓN DA RESOLUCIÓN: Taboeiro do Departamento de Matemáticas da UDC

VAZQUEZ
CENDON
CARLOS -
34946083K

Firmado digitalmente por VAZQUEZ CENDON CARLOS - 34946083K
 Nombre de reconocimiento (DN):
 c=ES, serialNumber=34946083K,
 sn=VAZQUEZ CENDON,
 givenName=CARLOS, cn=VAZQUEZ CENDON CARLOS - 34946083K
 Fecha: 2016.10.18 11:43:44 +02'00'

A Coruña, 18 de outubro de 2016
O/A INVESTIGADOR/A PRINCIPAL

Asdo.: Carlos Vázquez Cendón

Documentación que debe presentar o solicitante:

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

*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 UDC e os sindicatos CCOO e CIG

MEMORIA DA CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

DATOS DO PROXECTO

Título: Modelado Matemático, Análisis y Simulación Numérica de Problemas en Finanzas y Seguros, Procesos Industriales, Biotecnología y Medioambiente

Referencia: MTM2013-47800-C2-1-P

Investigador Principal: Carlos Vázquez Cendón

DETALLES DA CONVOCATORIA

Tarefas a realizar:

- Análise matemática dos modelos valoración de derivados de tipos de xuro baseados no LIBOR market model incorporando volatilidad estocástica mediante modelos SABR.
- Resolución numérica dos modelos de ecuaciones en derivadas parciais mediante métodos numéricos de tipo sparse grids e comparación cos resultados de formulacións baseadas en esperanzas, métodos numéricos para ecuacións estocásticas e simulación Monte Carlo
- Implementación de métodos de simulación dos modelos en ordenador.

Xustificación da duración do contrato: O tempo estimado para desenvolver este traballo é de 6 meses, e comprenderá as seguintes etapas:

- Análise matemática dos modelos de ecuacións en derivadas parciais
- Estudio e implementación dos métodos numéricos axeitados para resolución dos modelos

Requisitos dos candidatos:

- Formación predoutoral no ámbito da matemática financeira: modelos, métodos numéricos e implementación en ordenador.
- Experiencia investigadora no modelado e simulación numérica de problemas financeiros baseados en ecuacións diferenciais estocásticas e en derivadas parciais, programación de métodos numéricos e paralelización en GPUs, avalada polas publicación científicas en revistas indexadas no JCR

Criterios e valoración de méritos:

Concepto	Puntuación	Máximo
Expediente académico da enxeñería, licenciatura ou grados equivalentes	Nota mínima para a súa valoración 8 sobre 10	4 puntos
Máster con formación afín as tarefas a desenvolver (Enxeñería Matemática, Matemática Industrial, etc)	Nota mínima para a súa valoración 8,5 sobre 10	4 puntos
Experiencia predoutoral en tarefas de investigación relacionadas coas tarefas a realizar	0,25 Puntos x mes traballado	20 puntos
Premio extraordinario da licenciatura, enxeñería ou grados equivalentes	2 puntos por premio	2 puntos
Experiencia posdoutoral 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	25 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.

**VAZQUEZ
CENDON
CARLOS -
34946083K**

Firmado digitalmente por VAZQUEZ
CENDON CARLOS - 34946083K
Nombre de reconocimiento (DN):
c=ES, serialNumber=34946083K,
sn=VAZQUEZ CENDON,
givenName=CARLOS, cn=VAZQUEZ
CENDON CARLOS - 34946083K
Fecha: 2016.10.18 11:45:00 +02'00'

**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 UDC e os sindicatos CCOO e CIG*

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
- Expediente académico da enxeñería, licenciatura ou grados equivalentes, e do mestrado
- Curriculum vitae

Lugar de presentación: Por correo electrónico a carlosv@udc.es

Prazo de presentación: 10 días desde a publicación da convocatoria no taboleiro da sede electrónica da UDC

VAZQUEZ
CENDON
CARLOS -
34946083K

Firmado digitalmente por
VAZQUEZ CENDON CARLOS -
34946083K
Nombre de reconocimiento (DN):
c=ES, serialNumber=34946083K,
sn=VAZQUEZ CENDON,
givenName=CARLOS,
cn=VAZQUEZ CENDON CARLOS -
34946083K
Fecha: 2016.10.18 11:46:47 +02'00'

Documentación que debe presentar o solicitante:

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

**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 UDC e os sindicatos CCOO e CIG*