

ANEXO III

2018/CP/033

MODELO DE CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN**AXUDA**

Referencia: MTM2016-76497-R

Título: Métodos matemáticos y simulación numérica para retos en finanzas cuantitativas, medioambiente, biotecnología y eficiencia industrial

CENTRO: Facultade de Informática

OBJECTO 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

16/04/2018

RETRIBUCIÓN BRUTAS : 2000,01 €/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: Doutor en Matemáticas.

EXPERIENCIA: Ver memoria da convocatoria

OUTROS REQUISITOS: Os requisitos deben terse cumprido no momento de finalizar o prazo de presentación da solicitude.

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

A Coruña, 2 de marzo de 2018

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: Métodos matemáticos y simulación numérica para retos en finanzas cuantitativas, medioambiente, biotecnología y eficiencia industrial

Referencia: MTM2016-76497-R

Investigador Principal: Carlos Vázquez Cendón

DETALLES DA CONVOCATORIA

Tarefas a realizar:

- Resolución de problemas de valoración de opciones con riesgo de contrapartida y cálculo de XVA mediante técnicas de tipo Monte Carlo implementadas en GPUs
- Resolución numérica de modelos de ecuaciones diferenciales parciales para valoración de derivados en mercados de energía mediante métodos de *sparse grids*.
- **Xustificación da duración do contrato:** O tempo estimado para desenvolver este traballo é de 6 meses, tempo adecuado para realizar as tarefas sinaladas anteriormente.

Requisitos dos candidatos:

- Formación predoutoral no ámbito do modelado matemático de problemas de finanzas cuantitativas baseadas en ecuacións estocásticas e en derivadas parciais, métodos numéricos para resolvelas e a súa programación en ordenador, incluíndo técnicas de paralelización.
- Experiencia investigadora en modelado e simulación numérica de problemas de valoración de derivados financeiros mediante ecuacións estocásticas e en derivadas parciais (Monte Carlo, *sparse grids*, etc), así como no uso de ferramentas de paralelización de tipo GPUs, avalada por publicacións científicas en revistas no JCR, capítulos de libros e comunicacións en congresos científicos.

Criterios e valoración de méritos:

Concepto	Puntuación	Máximo
Máster con formación afín as tarefas a desenvolver (Enxeñería Matemática, Matemática Industrial, etc)	Valoración da media do expediente académico sobre 4 (mínimo 3 puntos)	4 puntos
Experiencia predoutoral en tarefas de investigación relacionadas coas tarefas a realizar	0,25 puntos x mes traballado	20 puntos
Premio extraordinario de doutoramento, outros premios científicos e/ou mención internacional en teses relacionadas coa temática das tarefas a realizar	4 puntos por premio extraordinario, 2 puntos por outros premios, 2 puntos por mención internacional	6 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	30 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		15 puntos

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

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*