

ANEXO III

2021/CP/264

CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN
AYUDA

Referencia: ABC-EU-XVA ITN-EID PROJECT			
Título: "Valuation adjustments for improved risk management"			
CENTRO: Facultade de Informática.			
OBJETO DEL CONTRATO: Investigación en formación asociado al proyecto ABC-EU-XVA de la convocatoria H2020 EU Marie Curie Initial Training Network.			
LUGAR Y HORARIO: Facultade de Informática, de 9:00-14:00 h. y de 16:00-19:00 h. de lunes a jueves, de 9:00-14:30 h. viernes.			
GRUPO DE COTIZACIÓN EN EL RÉGIMEN GENERAL DE LA SEGURIDAD SOCIAL: Grupo I			
CATEGORÍA PROFESIONAL *(ACUERDO DEL 17 DE NOVIEMBRE DE 2014 SOBRE EL PERSOAL CONTRATADO CON CARGO AL CAPÍTULO VI DE LOS PRESUPUESTOS DE LA UDC)			
Investigador asociado ☐		* Investigador en formación ☒ * Require matrícula programa doutoramento SUG	
Técnico de apoyo a la investigación ☐		Ayudante de apoyo a la investigación ☐	
Técnico administrativo ☐		Ayudante administrativo ☐	
JORNADA	Tiempo Completo: ☒	Tiempo Parcial: ☐	
DURACIÓN	9 meses	FECHA APROX. DE INICIO	01/02/2022
RETRIBUCIONES BRUTAS : 2735.83 €/mes (incluidas pagas extras prorrateadas).			
PARTIDA PRESUPUESTARIA: 6140.280098.541A.64902.00			

* el pago de la retribución se realizará en 12 mensualidades (se incluye en cada mensualidad la parte proporcional de paga extraordinaria correspondiente)

REQUISITOS

TITULACIÓN:
1. De acuerdo a la normativa de la UDC, los candidatos deben estar matriculados en un programa de doctorado de una universidad del SUG.
2. De acuerdo a los requisitos de movilidad del programa Marie Skłodowska Curie, en el momento de la convocatoria, el candidato no puede haber residido ni llevado a cabo su actividad principal más de 12 meses en los últimos tres años en el país donde está la institución receptora.
EXPERIENCIA: En la fecha de la convocatoria, los candidatos deben estar iniciando su carrera investigadora (Early Stage Researcher) y no poseer un título de doctor.
REQUISITOS: Los requisitos deben de tenerse cumplidos en el momento de finalizar el plazo de presentación de solicitudes.

LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES Y DOCUMENTACIÓN

LUGAR: Por correo electrónico en un archivo .zip a Carlos Vázquez Cendón (carlosv@udc.es)
PLAZO: 10 días desde la publicación en el tablón de anuncios de la sede electrónica de la UDC

ÓRGANO DE SELECCIÓN Y PUBLICACIÓN RESOLUCIÓN

ÓRGANO: Carlos Vázquez Cendón (IP del proyecto).
LUGAR DE PUBLICACIÓN DE LA RESOLUCIÓN: Tablón de anuncios del Departamento de Matemáticas de la FIC.

A Coruña, 24 de noviembre de 2021.
EL/LA 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

Código Seguro De Verificación	GUuFjB8HBNiem6Ijc8JDTg==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	24/11/2021 13:29:02
Observacións		Páxina	1/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/GUuFjB8HBNiem6Ijc8JDTg==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		



MEMORIA DE LA CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

INFORMACIÓN DEL PROYECTO

Título: ABC-EU-XVA ("Valuation adjustments for improved risk management")

Referencia: Grant Agreement no: 813261 in the MSCA-ITN-2018-EID: Marie Skłodowska-Curie Innovative Training Networks (ITN-EID)

Investigador Principal: Carlos Vázquez Cendón.

DETALLE DE LA CONVOCATORIA

Tareas a realizar:

La investigación se llevará a cabo en el contexto del proyecto ABC-EU-XVA de la H2020 EU Marie Curie Initial Training Network, que brindará una oportunidad única para que 6 investigadores en las primeras etapas de sus carreras realicen actividades multidisciplinares, investiguen y obtengan una visión profunda de una variedad de aspectos del riesgo de contraparte financiera y sus consecuencias, bajo el prestigioso esquema de los Doctorados Industriales Europeos (EID) Marie Curie.

El objetivo del proyecto ABC-EU-XVA es obtener una mayor experiencia en el riesgo de contraparte, los ajustes de valoración modernos y cómo incluirlos en los modelos matemáticos financieros modernos, en algoritmos, software, (grandes) datos. El candidato a doctorado se unirá a la comunidad ABC-UE-XVA y participará en los eventos ABC-UE-XVA en Europa.

El estudiante de doctorado trabajará en las EDPs y el modelado híbrido de XVA. Cuando surge una alta dimensionalidad en XVA, un enfoque computacional híbrido de MC que enfatiza la reducción de la dimensión y la varianza puede ser atractivo y novedoso. Esto es especialmente importante para XVA a nivel de cartera, que involucra muchos derivados diferentes. Un enfoque computacional híbrido de Monte Carlo (MC) se construirá sobre una combinación de MC y los otros enfoques, uniendo así las principales ventajas de los métodos individuales. Se incluirán métodos de valoración eficientes en los paquetes de software.

Justificación de la duración del contrato: 9 meses para un investigador iniciando su carrera investigadora son razonables y suponen su integración en el proyecto ABC-EU-XVA.

Requisitos de los candidatos:

- De acuerdo a la normativa de la UDC, los candidatos deben estar matriculados en un programa de doctorado de una universidad del SUG.
- De acuerdo a los requisitos de movilidad del programa Marie Skłodowska Curie, en el momento de la convocatoria, el candidato no puede haber residido ni llevado a cabo su actividad principal más de 12 meses en los últimos tres años en el país donde está la institución receptora.

Criterios de valoración:

- Expediente de grado (Grado en Matemáticas, Matemáticas aplicadas o Matemáticas financieras o equivalente): 30%, mínimo unas calificaciones de 3 sobre 4 en el grado. En otros grados se aplica coeficiente 0.2 a la puntuación anterior.
- Expediente de máster (Máster en Matemáticas, Matemáticas aplicadas o Matemáticas financieras o equivalente): 20% mínimo unas calificaciones de 3 sobre 4 en el máster. En otros másters se aplica coeficiente 0.2 a la puntuación anterior.
- Publicaciones: 10 %, artículos en JCR, 1 punto por artículo.
- Experiencia y formación relacionada con la línea de investigación del doctorado: 10%, experiencia mínima de 6 meses o máster adicional en temas relacionados a la posición, 1 punto por año de experiencia y 2 puntos por máster adicional.
- Nivel de inglés: 10%, máximo, correspondiendo a un nivel B2 (First Certificate).
- Entrevista en inglés: 20 %.

La puntuación máxima corresponde a 100 puntos.

Documentación que debe presentar o solicitante:

- Fotocopia D.N.I.
- Fotocopia da titulación académica.
- 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*

Código Seguro De Verificación	GUUfjB8HBNiem6Ijc8JDTg==		Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón		Asinado	24/11/2021 13:29:02
Observacións			Página	2/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/GUUfjB8HBNiem6Ijc8JDTg==			
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).			



Documentación que debe presentar o solicitante:

- Carta de motivación en inglés, indicando la referencia de la convocatoria.
- CV detallado.
- Copia del DNI o pasaporte.
- Expediente detallado de la titulación de grado y de máster.
- Listado de publicaciones.
- Acreditación de estar matriculado del doctorado en una universidad del SUG.

Lugar de presentación: Por correo electrónico a carlosv@udc.es**Prazo de presentación:** 10 días desde la publicación de la convocatoria en el tablón de la sede electrónica de la 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*

Código Seguro De Verificación	GUuFjB8HBNiem6Ijc8JDTg==		
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Estado	Data e hora
Observacións		Asinado	24/11/2021 13:29:02
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/GUuFjB8HBNiem6Ijc8JDTg==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		



ANNEXE III

2021/CP/264

FORM OF THE RECRUITMENT CALL
GRANT:

Reference: ABC-EU-XVA ITN-EID PROJECT			
Title: "Valuation adjustments for improved risk management"			
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 "ABC-EU-XVA"			
Place and timetable: Faculty of Informatics, 9:00-14:00 h. and 16:00-19:00 h. Monday to Thursday and 9:00-14:30 h. Fridays			
GROUP IN THE GENERAL REGIME OF SOCIAL SECURITY			
PROFESSIONAL LEVEL* (AGREEMENT 17 NOVEMBER 2014 ABOUT HIRED STAFF BELONGING TO CHAPTER VI DOF UDC BUDGET)			
Associated researcher ☐		Researcher in training ☒	
Technician to support research ☐		Assistant to support research ☐	
Administrative staff ☐		Administrative assistant ☐	
Dedication regime	Full time: ☒	Part time: ☐	
Position duration	9 months	Envisaged starting date	01 February 2022
GROSS SALARY : 2.735,83 €/month (12 monthly payments, the proportional part of the extraordinary payment is already included in each monthly payment)			
BUDGET ITEM: 6140.280098.541A.64902.00			

REQUIREMENTS

1. 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
2. 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: 10 days since the publication of the call in the UDC electronic website

SELECTION COMMITTEE AND ANNOUNCEMENT OF SELECTION RESULTS:

Recruitment Committee: Carlos Vázquez Cendón (main researcher of the project)

Publication of results: Announcements panel at Department of Mathematics, Faculty of Informatics

A Coruña, 24 of November of 2021

Signed: Carlos Vázquez Cendón, Main Researcher

**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*

Código Seguro De Verificación	OBWVAWRQCwW9Mo+oJP6Apw==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	24/11/2021 13:29:04
Observacións		Páxina	1/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/OBWVAWRQCwW9Mo+oJP6Apw==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		



SUMMARY OF THE RECRUITMENT CALL

PROJECT DATA

Title: ABC-EU-XVA ("Valuation adjustments for improved risk management")

Reference: Grant Agreement no: 813261 in the MSCA-ITN-2018-EID:Marie Skłodowska-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 "ABC-EU-XVA", which will provide a unique opportunity, for 6 researchers in early stages of their careers, to perform multi-disciplinary research and gain deep insight into a variety of aspects of financial counterparty risk and their consequences, under the prestigious scheme of the Marie Curie European Industrial Doctorates (EID).

The aim of the ABC-EU-XVA project is to gain deeper expertise in counterparty risk, modern valuation adjustments and how to include them in the modern financial mathematical models, in algorithms and software. The PhD candidate will join the ABC-EU-XVA community, and take part in the ABC-EU-XVA events in Europe.

The PhD student will work on the PDEs and hybrid modeling of XVA. When high-dimensionality arises in XVA, a hybrid MC computational approach that emphasizes dimension and variance reduction may be appealing and of high novelty. This is especially important for XVA at portfolio level, involving many different derivatives. A hybrid Monte Carlo (MC) computational approach will be built upon a combination of MC and the other approaches, thus joining the main individual method advantages.

Motivation of the call:

This 9 month ESR position belongs to the European ITN-EID ABC-EU-XVA.

Candidates requirements:

1. 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
2. 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:

- Batchelor (Batchelor in Mathematics, Applied Mathematics or Financial Mathematics) transcripts: 30%, minimum rates 3 out of 4 at batchelor, in other batchelors, a coefficient 0.2 is applied to the previous score.
- Master (Master in Mathematics, Applied Mathematics or Financial Mathematics) transcripts: 20%, minimum rates 3 out of 4 at master level, in other masters a coefficient 0.2 is applied to the previous score.
- 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.

**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*

Código Seguro De Verificación	OBWVAWRQCwW9Mo+oJP6Apw==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	24/11/2021 13:29:04
Observacións		Páxina	2/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/OBWVAWRQCwW9Mo+oJP6Apw==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		



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: 10 days since the publication of the call in the UDC electronic website

**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*

Código Seguro De Verificación	OBWVAWRQCwW9Mo+oJP6Apw==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	24/11/2021 13:29:04
Observacións		Páxina	3/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/OBWVAWRQCwW9Mo+oJP6Apw==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		

