

CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

AXUDA

Referencia: ABC-EU-XVA ITN-EID PROJECT

Título: "Valuation adjustments for improved risk management"

CENTRO: Facultade de Informática.

OBXECTO DO CONTRATO: Investigación en formación asociado al proyecto ABC-EU-XVA de la convocatoria H2020 EU Marie Curie Initial Training Network.

Colaborador/a nas tarefas do (proxecto/convenio) de investigación que se indica.

LUGAR E HORARIO: Facultade de Informática, de 9:00-14:00 h. e de 16:00-19:00 h. de luns a xoves, de 9:00-14:30 h. 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 ☒ * Require matrícula programa doutoramento SUG

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

 Técnico administrativo ☐ Axudante administrativo ☐

 XORNADA Tempo Completo: ☒ Tempo Parcial: ☐

DURACIÓN 9 meses DATA APROX. DE INICIO 01/02/2022

RETRIBUCIÓN BRUTAS : 2735.83 €/mes (incluidas pagas extras prorrateadas).

PARTIDA ORZAMENTARIA: 6140.280098.541A.64902.00

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

REQUISITOS
TITULACIÓN:

- De acordo á normativa da UDC, os candidatos deben estar matriculados nun programa de doutoramento dunha universidade do SUG.
- De acordo aos requisitos de mobilidade do programa Marie Skłodowska Curie, no momento da convocatoria, o candidato non pode residir nin levar a cabo a súa actividade principal máis de 12 meses no últimos tres anos no país onde está a institución receptora.

EXPERIENCIA: Na data da convocatoria, os candidatos deben estar iniciando a súa carreira investigadora (Early Stage Researcher) e non posuír un título de doutor.

REQUISITOS: 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 en un archivo .zip a Carlos Vázquez Cendón (carlosv@udc.es)

PRAZO: 10 días desde a publicación no taboleiro de anuncios da sede electrónica da UDC

ÓRGANO DE SELECCIÓN E PUBLICACIÓN RESOLUCIÓN

ÓRGANO: Carlos Vázquez Cendón (IP do proxecto).

LUGAR DE PUBLICACIÓN DA RESOLUCIÓN: Taboleiro de anuncios do Departamento de Matemáticas da FIC

A Coruña/Ferrol, 24 de novembro de 2021
O/A INVESTIGADOR/A PRINCIPAL. Asdo.: Carlos Vázquez Cendón
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. Contratación condicionada á existencia de crédito adecuado e suficiente.

Código Seguro De Verificación	NNx+7rcN4Cbcqc84zFnXJg==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	24/11/2021 14:02:26
Observacións		Páxina	1/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/NNx+7rcN4Cbcqc84zFnXJg==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		



MEMORIA DA CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

INFORMACIÓN DO PROXECTO

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 DA CONVOCATORIA

Tarefas a realizar:

A investigación levaráse a cabo no contexto do proxecto ABC- EU- XVA da H2020 EU Marie Curie Initial Training Network, que brindará unha oportunidade única para que 6 investigadores nas primeiras etapas das súas carreiras realicen actividades multidisciplinares, investiguen e obteñan unha visión profunda dunha variedade de aspectos do risco de contraparte financeira e as súas consecuencias, baixo o prestixioso esquema dos Doutoramentos Industriais Europeos (EID) Marie Curie.

O obxectivo do proxecto ABC- EU- XVA é obter unha maior experiencia no risco de contraparte, os axustes de valoración modernos e como incluílos nos modelos matemáticos financeiros modernos, en algoritmos, software, (grandes) datos. O candidato a doutoramento unirase á comunidade ABC-UE- XVA e participará nos eventos ABC-UE- XVA en Europa.

O estudante de doutoramento traballará nas EDPs e o modelado híbrido de XVA. Cando xorde unha alta dimensionalidade en XVA, un enfoque computacional híbrido de MC que salienta a redución da dimensión e a varianza pode ser atractivo e novo. Isto é especialmente importante para XVA a nivel de carteira, que involucra moitos derivados diferentes. Un enfoque computacional híbrido de Monte Carlo (MC) constrúese sobre unha combinación de MC e os outros enfoques, unindo así as principais vantaxes dos métodos individuais. Inclúiranse métodos de valoración eficientes nos paquetes de software.

Xustificación da duración do contrato: 9 meses para un investigador iniciando a súa carreira investigadora son razoables e supoñen a súa integración no proxecto ABC- EU- XVA.

Requisitos dos candidatos:

- De acordo á normativa da UDC, os candidatos deben estar matriculados nun programa de doutoramento dunha universidade do SUG.
- De acordo aos requisitos de mobilidade do programa Marie Skłodowska Curie, no momento da convocatoria, o candidato non pode residir nin levar a cabo a súa actividade principal máis de 12 meses no últimos tres anos no país onde está a institución receptora.

Criterios de valoración:

- Expediente de grao (Grao en Matemáticas, Matemáticas aplicadas ou Matemáticas financeiras ou equivalente) e de máster: 30%, mínimo unhas cualificacións de 3 sobre 4 no grao. Noutros graos aplícase coeficiente 0.2 á puntuación anterior.
- Expediente de máster (Máster en Matemáticas, Matemáticas aplicadas ou Matemáticas financeiras ou equivalente): 20%, mínimo unhas cualificacións de 3 sobre 4 no máster. Noutros másteres aplícase coeficiente 0.2 á puntuación anterior.
- Publicacións: 10 %, artigos en JCR, 1 punto por artigo.
- Experiencia e formación relacionada coa liña de investigación do doutoramento: 10%, experiencia mínima de 6 meses ou máster adicional en temas relacionados á posición, 1 punto por ano de experiencia e 2 puntos por máster adicional.
- Nivel de inglés: 10%, máximo, correspondendo a un nivel B2 (First Certificate).
- Entrevista en inglés: 20 %.

A 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. Contratación condicionada á existencia de crédito adecuado e suficiente.*

Código Seguro De Verificación	NNx+7rcN4Cbcqc84zFnXJg==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	24/11/2021 14:02:26
Observacións		Páxina	2/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/NNx+7rcN4Cbcqc84zFnXJg==		
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 a referencia da convocatoria.
- CV detallado.
- Copia do DNI ou pasaporte.
- Expediente detallado da titulación de grao e de máster.
- Listaxe de publicacións.
- Acreditación de estar matriculado do doutoramento nunha universidade do SUG.

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. Contratación condicionada á existencia de crédito adecuado e suficiente.*

Código Seguro De Verificación	NNx+7rcN4Cbcqc84zFnXJg==		
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Estado	Data e hora
Observacións		Asinado	24/11/2021 14:02:26
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/NNx+7rcN4Cbcqc84zFnXJg==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		

