



CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

Referencia ayuda: ABC-EU-XVA ITN-EID PROJECT (Remaining funds)			
Título: Valuation adjustments for improved risk management			
Línea de investigación / Servicios científico-técnicos: Capital valuations adjustments (KVA)			
PERÍODO AYUDA: INICIO: 01/11/2022 FIN: 31/10/2024			
CENTRO Inv. Principal: Facultade de Informática. Carlos Vázquez Cendón			
OBJETO DEL CONTRATO: Modelos matemáticos y métodos numéricos para XVA con énfasis en capital regulatorio (KVA)			
Colaborador/a en las tareas del (proyecto/convenio) de investigación que se indica.			
LUGAR Y HORARIO: Facultade de Informática, Universidade da Coruña. 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 PERSONAL CONTRATADO CON CARGO AL CAPÍTULO VI DE LOS PRESUPUESTOS DE LA UDC)			
Investigador/a asociado/a ☐		Investigador/a en formación ☒ * Requiere matrícula programa doctorado SUG	
Técnico/a de apoyo a la investigación ☐		Ayudante de apoyo a la investigación ☐	
Técnico/a administrativo/a ☐		Ayudante administrativo/a ☐	
JORNADA	Tiempo Completo: ☒	Tiempo Parcial: ☐	FECHA APROX. INICIO CONTRATO: 01/01/2023
TIPO DE CONTRATO: Indefinido ☐		Duración determinada ☒	
		FECHA FIN CONTRATO: 31/10/2024	
RETRIBUCIONES BRUTAS : 1.925,00 €/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 la paga extraordinaria correspondiente)

REQUISITOS

TITULACIÓN: Los candidatos deben de estar matriculado en un programa de doctorado del SUG.
REQUISITOS: Los requisitos descritos en la MEMORIA anexa deben de haberse cumplido en el momento de finalizar el plazo de presentación de solicitudes.

LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES Y DOCUMENTACIÓN

LUGAR: Sede electrónica de la UDC.
Dirigidas al Vicerrectorado de Política Científica, Investigación y Transferencia, con la Referencia de la convocatoria .
PLAZO: 10 días hábiles a partir del día siguiente al de la publicación en el tablón de anuncios de la Sede electrónica de la UDC.

ÓRGANO DE SELECCIÓN Y PUBLICACIÓN RESOLUCIÓN

COMISIÓN DE SELECCIÓN (mínimo tres titulares y dos suplentes): Carlos Vázquez Cendón, Íñigo Arregui Álvarez, José Germán López Salas. Suplentes: Ana María Ferreiro Ferreiro, José Antonio García Rodríguez.
LUGAR DE PUBLICACIÓN DE LA RESOLUCIÓN: Tablón de anuncios de la Sede electrónica de la UDC.

A Coruña, 18 de octubre de 2022
EL/LA INVESTIGADOR/A PRINCIPAL

Fdo.: Carlos Vázquez Cendón

Documentación que debe presentar el solicitante:

1. Fotocopia del documento identidad.
2. Fotocopia de la titulación académica.
3. Curriculum vitae.

*Acuerdo sobre clasificación profesional, condiciones de trabajo y marco de referencia de la representatividad laboral del personal contratado con cargo a proyectos y convenios de I+D+I financiados a través del capítulo VI de los presupuestos de la UDC. Firmado el 17/11/2014 entre la UDC y los sindicatos CCOO y CIG. Contratación condicionada a la existencia de crédito adecuado y suficiente.

Código Seguro De Verificación	AAKQ7qc93327DSq90CfhUA==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	26/10/2022 13:31:26
Observacións		Página	1/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/AAKQ7qc93327DSq90CfhUA==		
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

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: Colaborar en tareas de investigación relacionadas con modelos matemáticos y métodos numéricos para XVA con énfasis en capital regulatorio (KVA). El modelado se abordará mediante PDEs y BSDEs. Extensión a la configuración de divisas cruzadas de KVA utilizando modelos de alta dimensión.

Requisitos de los candidatos:

- El candidato debe estar matriculado en un Programa de Doctorado de una Universidad Gallega (SUG).

Criterios de selección:

Los méritos aportados por los participantes deberán ser documentados y cumplidos al finalizar el plazo de presentación de solicitudes.

Sólo se valorarán los méritos relacionados con el perfil del puesto.

Criterios de valoración:

Se considerarán titulaciones de Matemáticas, Matemática Aplicada o Matemática Financiera

- Expediente de grado: 25 %, mínimo unas calificaciones de 3 sobre 4 en el grado.
- Expediente de máster: 25 %, mínimo unas calificaciones de 3 sobre 4 en el máster.
- Publicaciones: 10 %, artículos en lista JCR 1 puntos por artículo
- Experiencia y formación relacionada con la descripción del puesto: 10 %, mínimo 9 meses de experiencia o máster adicional en temas relacionados con el puesto, 1 punto por mes de experiencia y 2 puntos por máster adicional
- Nivel de inglés: 10 %, correspondiendo a un nivel First Certificate (B2) o equivalente
- Entrevista en inglés: 20 %

Máximo total de puntos igual a 100.

Documentos a presentar por los candidatos:

- Una carta de motivación solicitando el puesto,
- Un currículum detallado,
- Copia del pasaporte o DNI,
- Expediente detallado de la titulación de grado y máster.
- Una lista de publicaciones, si es el caso
- Un certificado de estar matriculado en el doctorado. Programa en cualquier Universidad de Galicia.

Documentación que debe presentar el solicitante:

1. Fotocopia del documento identidad.
2. Fotocopia de la titulación académica.
3. Curriculum vitae.

**Acuerdo sobre clasificación profesional, condiciones de trabajo y marco de referencia de la representatividad laboral del personal contratado con cargo a proyectos y convenios de I+D+I financiados a través del capítulo VI de los presupuestos de la UDC. Firmado el 17/11/2014 entre la UDC y los sindicatos CCOO y CIG. Contratación condicionada a la existencia de crédito adecuado y suficiente.*

Código Seguro De Verificación	AAKQ7qc93327DSq90CfhUA==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	26/10/2022 13:31:26
Observacións		Páxina	2/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/AAKQ7qc93327DSq90CfhUA==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		



Presentación de solicitudes: Sede electrónica de la UDC.

Plazo de presentación de solicitudes: 10 días a partir del día siguiente al de la publicación en el tablón de anuncios de la Sede electrónica de la UDC.

Lugar de publicación de resultados: Tablón de anuncios de la Sede electrónica de la UDC.

Investigador principal:

Carlos Vázquez Cendón.

Documentación que debe presentar el solicitante:

1. Fotocopia del documento identidad.
2. Fotocopia de la titulación académica.
3. Curriculum vitae.

**Acuerdo sobre clasificación profesional, condiciones de trabajo y marco de referencia de la representatividad laboral del personal contratado con cargo a proyectos y convenios de I+D+I financiados a través del capítulo VI de los presupuestos de la UDC. Firmado el 17/11/2014 entre la UDC y los sindicatos CCOO y CIG. Contratación condicionada a la existencia de crédito adecuado y suficiente.*

Código Seguro De Verificación	AAkQ7qc93327DSq90CfhUA==		Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón		Asinado	26/10/2022 13:31:26
Observacións			Páxina	3/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/AAkQ7qc93327DSq90CfhUA==			
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).			

