



CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

Referencia axuda: ABC-EU-XVA ITN-EID PROJECT (Remaining funds)		
Título: Valuation adjustments for improved risk management		
Liña de investigación / Servizos científico-técnicos: Capital valuations adjustments (KVA)		
PERÍODO AXUDA:	INICIO: 01/11/2022	FIN: 31/10/2024
CENTRO Inv. Principal: Facultade de Informática. Carlos Vázquez Cendón		
OBJECTO DO CONTRATO: Modelos matemáticos e métodos numéricos para XVA con énfasis en capital regulatorio (KVA)		
Colaborador/a nas tarefas do (proxecto/convenio) de investigación que se indica.		
LUGAR E 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 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/a asociado/a	☐	Investigador/a en formación ☒ * Require matrícula programa doutoramento SUG
Técnico/a de apoio á investigación	☐	Axudante de apoio á investigación ☐
Técnico/a administrativo/a	☐	Axudante administrativo/a ☐
XORNADA	Tempo Completo: ☒	Tempo Parcial: ☐ DATA APROX. INICIO CONTRATO: 01/01/2023
TIPO DE CONTRATO:	Indefinido ☐	Duración determinada ☒ DATA FIN CONTRATO: 31/10/2024
RETRIBUCIÓN BRUTAS : 1.925,00 €/mes (incluídas 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 da paga extraordinaria correspondente)

REQUISITOS

TITULACIÓN: Os candidatos deben estar matriculados nun programa de doutoramento do SUG.

REQUISITOS: Os requisitos descritos na MEMORIA anexa deben terse cumprido no momento de finalizar o prazo de presentación de solicitudes.

LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES E DOCUMENTACIÓN

LUGAR: Sede electrónica da UDC.

Dirixidas á Vicerreitoría de Política Científica, Investigación e Transferencia, coa **Referencia da convocatoria**.

PAZO: 10 días hábiles a partir do día seguinte ao da publicación no taboleiro de anuncios da Sede electrónica da UDC.

ÓRGANO DE SELECCIÓN E PUBLICACIÓN RESOLUCIÓN

COMISIÓN DE SELECCIÓN (mínimo tres titulares e dous suplentes): Carlos Vázquez Cendón, Íñigo Arregui Álvarez, José Germán López Salas. Suplentes: Ana María Ferreiro Ferreiro, José Antonio García Rodríguez

LUGAR DE PUBLICACIÓN DA RESOLUCIÓN: Taboleiro de anuncios da Sede electrónica da UDC.

A Coruña, 18 de outubro de 2022

O/A INVESTIGADOR/A PRINCIPAL

Asdo.: Carlos Vázquez Cendón.

Documentación que debe presentar o solicitante:

1. Fotocopia do documento identidade.
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	jLt8AbiFEsodYwjtFuoeHQ==	Estado	Data e hora
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Asinado	26/10/2022 13:31:30
Observacións		Páxina	1/3
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/jLt8AbiFEsodYwjtFuoeHQ==		
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

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: Colaborar en tarefas de investigación relacionadas con modelos matemáticos e métodos numéricos para XVA con énfases en capital regulatorio (KVA). O modelado abordarse mediante PDEs e BSDEs. Extensión á configuración de divisas cruzadas de KVA utilizando modelos de alta dimensión.

Requisitos dos candidatos:

- O candidato debe estar matriculado nun Programa de Doutoramento dunha Universidade Galega (SUG).

Criterios de selección:

Os méritos achegados polos participantes deberán ser documentados e cumpridos ao finalizar o prazo de presentación de solicitudes.

Só se valorarán os méritos relacionados co perfil do posto.

Criterios de valoración:

Consideraranse titulacións en Matemáticas, Matemática Aplicada ou Matemática Financeira

- Expediente de grao: 25%, mínimo unhas cualificacións de 3 sobre 4 no grao.
- Expediente de máster: 25%, mínimo unhas cualificacións de 3 sobre 4 no máster.
- Publicacións: 10%, artigos en lista JCR 1 punto por artigo
- Experiencia e formación relacionada coa descrición do posto: 10%, mínimo 9 meses de experiencia ou máster adicional en temas relacionados co posto, 1 punto por mes de experiencia e 2 puntos por máster adicional
- Nivel de inglés: 10% máximo, correspondendo a un nivel First Certificate (B2) ou equivalente
- Entrevista en inglés: 20%

Máximo total de puntos igual a 100.

Documentos a presentar polos candidatos:

- Unha carta de motivación solicitando o posto.
- Un currículo detallado,
- Copia do pasaporte ou DNI,
- Expediente detallado da titulación de grao e máster.
- Unha lista de publicacións, se é o caso
- Un certificado de estar matriculado no doutoramento. Programa en calquera Universidade de Galicia.

Documentación que debe presentar o solicitante:

1. Fotocopia do documento identidade.
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	jLt8AbiFEsodYwjtFuoeHQ==		
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Estado	Data e hora
Observacións		Asinado	26/10/2022 13:31:30
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/jLt8AbiFEsodYwjtFuoeHQ==		
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 da UDC.

Prazo de presentación de solicitudes: 10 días a partir do día seguinte ao da publicación no taboleiro de anuncios da Sede electrónica da UDC.

Lugar de publicación de resultados: Taboleiro de anuncios da Sede electrónica da UDC.

Investigador principal:

Carlos Vázquez Cendón.

Documentación que debe presentar o solicitante:

1. Fotocopia do documento identidade.
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 sindicados CCOO e CIG. Contratación condicionada á existencia de crédito adecuado e suficiente.*

Código Seguro De Verificación	jLt8AbiFEsodYwjtfuoeHQ==		
Asinado Por	Director/a Departamento Matemáticas - Carlos Vázquez Cendón	Estado	Data e hora
Observacións		Asinado	26/10/2022 13:31:30
Url De Verificación	https://sede.udc.gal/services/validation/jLt8AbiFEsodYwjtfuoeHQ==		
Normativa	Este informe ten o carácter de copia electrónica auténtica con validez e eficacia administrativa de ORIGINAL (art. 27 Lei 39/2015).		

