



ANEXO III

CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

ACTIVIDADE

Título: Modelos, análisis matemático y resolución numérica de algunos problemas en ciencia e ingeniería basados en EDPs (MTM2010-21135-C02-01)

CENTRO: Facultade de Informática

OBXECTO DO CONTRATO: Colaborar nas tarefas de investigación relacionadas co proxecto.

LUGAR: Departamento de Matemáticas - Facultade de Informática

HORARIO: De 10:00 a 14:00, de luns a venres

CATEGORÍA PROFESIONAL: Grupo I

XORNADA Tempo Completo: Tempo Parcial: (20 horas semanais)

DURACIÓN 6 meses (prorrogable) DATA APROX. DE INICIO 01.05.2014

RETRIBUCIÓN BRUTAS MENSUAIS: 784,93€

PARTIDA ORZAMENTARIA: 6140 210377 541A 6490200

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

REQUISITOS

TITULACIÓN: Licenciado en Matemáticas (ver memoria anexa)

EXPERIENCIA: Coñecementos de modelos matemáticos no ámbito das finanzas cuantitativas

OUTROS REQUISITOS: Estar cursando o ter cursado o máster de enxeñería matemática ou de matemática industrial. Non estar en posesión del título de doutor.

LUGAR DE PRESENTACIÓN DE SOLICITUDES E DOCUMENTACIÓN

LUGAR: Por correo electrónico a yparajo@udc.es

PRAZO: 10 días dende a publicación da convocatoria na páxina web da UDC

CRITERIOS E ÓRGANO DE SELECCIÓN

CRITERIOS: Valoración do currículo e posibilidade de entrevista persoal

ORGANO: Carlos Vázquez Cendón (Investigador Principal del proxecto)

A Coruña, 13 de marzo de 2013

O INVESTIGADOR PRINCIPAL

Asdo.: Carlos Vázquez Cendón

MEMORIA DA CONVOCATORIA DE CONTRATACIÓN

DATOS DO PROXECTO

Título: Modelos, análisis matemático y resolución numérica de algunos problemas en ciencias en ingeniería basados en EDPs

Referencia: MTM2010-21135-C02-01

Investigador Principal: Carlos Vázquez Cendón

DETALLES DA CONVOCATORIA

Tarefas a realizar: Trátase de incorporar o risco de contrapartida na valoración dunha carteira de derivados de tipos de interese, incorporando un modelo LGM de dous factores. Para iso propónse un modelo HJM de dous factores estocásticos calibrado a mercado. As tarefas son: calibración do modelo, motor de simulación, valoración baixo este modelo e cálculo do risco de contrapartida.

Xustificación da duración do contrato: O tempo estimado para realizar as tarefas do proxecto é de 6 meses

Requisitos dos candidatos: Os candidatos/as serán licenciados en matemáticas con bo expediente académico, coñecementos de modelos de finanzas e métodos numéricos estocástico, así como de programación dos mesmos.

Cráterios e valoración de méritos:

- Expediente académico da licenciatura (A nota mínima para a súa valoración e de 7 sobre 10): máx. 4 puntos
- Expediente académico dun mestrado universitario en enxeñería matemática ou equivalente (Valoráse a partir de 30 créditos superados): máx. 2 puntos
- Cursos recibidos directamente relacionados coas tarefas a realizar (0,2 puntos por curso): máx. 2 puntos
- Coñecementos de inglés, acreditados polo nivel básico (A2), intermedio (B1) ou avanzado (B2) da Escola Oficial de Idiomas ou titulación equivalente: máx. 1 puntos (0,5 punto máximos polo nivel básico e 0,5 puntos máximos polo nivel intermedio)
- Entrevista persoal, no caso de considerarse necesario: máx. 2 puntos

Documentación que debe presentar o solicitante:

- Instancia de solicitude indicando a referencia desta convocatoria que figura na publicación da web da UDC
- Fotocopia do DNI
- Fotocopia do título e do expediente académico
- Curriculum vitae
- Xustificantes de méritos incluídos no CV

Lugar de presentación: Por correo electrónico a yparajo@udc.es

Prazo de presentación: 10 días dende a publicación da convocatoria na páxina web da UDC