

## EDITAL PARA A ATRIBUIÇÃO DE BOLSAS NO ÂMBITO DE PROJETOS E INSTITUIÇÕES DE I&D

### Título: **1 Bolsa de Investigação na área da Matemática Financeira**

Encontra-se aberto concurso para a atribuição de 1 Bolsa de Investigação (BI) para Licenciados no âmbito do projeto de I&D **Análise Estocástica e Aproximações Numéricas em Matemática Financeira (SANAF)**, projeto desenvolvido pelo Instituto Superior Técnico da Universidade Técnica de Lisboa (IST/UTL) em parceria com o Instituto Superior de Economia e Gestão da Universidade Técnica de Lisboa (ISEG/UTL), Universidade dos Açores (UAçores), Carnegie Mellon University (CMU) e University of Texas at Austin (UTA) financiado por fundos nacionais através da Fundação para a Ciência e Tecnologia (FCT) ao abrigo dos programas Austin – Portugal e Carnegie Mellon – Portugal, através da Bolsa UTA\_CMU/MAT/0006/2009.

**Área Científica:** Matemática Financeira

**Requisitos de admissão:** Os candidatos devem ser licenciados, dando-se preferência a alunos inscritos em programas de mestrado relacionados com a área científica em que é aberto o concurso ou afins e que mostrem conhecimentos específicos relacionados com o plano de trabalhos a desenvolver.

**Plano de trabalhos:** Os candidatos deverão prestar apoio aos trabalhos de investigação sobre o tema “Interest Rate, Credit Risk and Other Term Structure Models” que têm vindo a ser desenvolvidos pelo CEMAPRE/ISEG no âmbito do projeto acima referido, nomeadamente através do desenvolvimento de estudos sobre “interest rate term structures”, “credit spread term structures”, “futures versus forward price term structures” ou “implied volatility term structures”.

**Legislação e regulamentação aplicável:** Lei Nº. 40/2004, de 18 de Agosto (Estatuto do Bolseiro de Investigação Científica); Regulamento da Formação Avançada e Qualificação de Recursos Humanos 2010.

**Local de trabalho:** O trabalho será desenvolvido no CEMAPRE do Instituto Superior de Economia e Gestão, Universidade Técnica, sob a orientação científica da Professora Doutora Raquel M. Gaspar.

**Duração da(s) bolsa(s):** A bolsa terá a duração de 6 meses, com início previsto a 17 de Fevereiro de 2014. O contrato de bolsa poderá ser renovado até ao máximo de 12 meses.

**Valor do subsídio de manutenção mensal:** O montante da bolsa corresponde a €745 mensais, conforme tabela de valores das bolsas atribuídas directamente pela FCT, I.P. no País (<http://alfa.fct.mctes.pt/apoios/bolsas/valores>). Pagos através de transferência bancária pelo CEMAPRE.

**Métodos de selecção:** Os métodos de selecção a utilizar serão os seguintes: (i) avaliação curricular, (ii) avaliação da carta de candidatura e das provas de conhecimento específico adequado ao plano de trabalhos. Cada método é avaliado numa escala de 0 a 20 valores e tem ponderação de 50% na nota final.

**Composição do Júri de Selecção:**

Presidente: CLÁUDIA PHILIPPARD NUNES, IST, Universidade Técnica de Lisboa

Vogais: RAQUEL MEDEIROS GASPAR, ISEG, Universidade Técnica de Lisboa

MANUEL CIDRAES CASTRO GUERRA, ISEG, Universidade Técnica de Lisboa

**Forma de publicitação/notificação dos resultados:** Os resultados finais da avaliação serão publicitados, através de lista ordenada por nota final obtida afixada em local visível e público no CEMAPRE, sendo os candidato(a)s aprovado(a)s notificados através de carta e *email*.

**Prazo de candidatura e forma de apresentação das candidaturas:** O concurso encontra-se aberto no período de 13 a 27 de Janeiro.

As candidaturas devem ser formalizadas, obrigatoriamente, através do envio de carta de candidatura acompanhada dos seguintes documentos: Curriculum Vitae detalhado e certificados de habilitações.

As candidaturas deverão ser entregues, pessoalmente, durante o período o horário de expediente (das 10-13h e das 14-18h) do CEMAPRE na morada a seguir indicada, ou remetidas por correio para:

CEMAPRE  
Projeto SANAF  
Rua do Quelhas 6  
1200-781 Lisboa  
Portugal