

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

Bolsa de Investigação (*estudante de mestrado ou mestrado integrado*)

Encontra-se aberto concurso para a atribuição de uma Bolsa(s) de Investigação, no âmbito do projeto/instituição de I&D, PTDC/EGE-ECO/30535/2017, financiado por fundos nacionais através da FCT/MCTES (PIDDAC), nas seguintes condições:

Área Científica: Probabilidades e Estatística

Requisitos de admissão: *estar inscrito num mestrado integrado ou num mestrado.*

Plano de trabalhos: O objetivo central é a análise de modelos de alocação de carteiras financeiras baseadas em risco, sendo estes a carteira de variância mínima, a carteira de contribuição igual de risco e carteira de máxima diversificação. Adicionalmente, são também utilizadas metodologias de Bandidos Adversários Multi-Braços, onde cada braço corresponde a cada um dos três modelos de carteira mencionados, com intuito de averiguar se estas conseguem obter melhores resultados do que cada modelo de optimização de carteira individual. Para além disso, para cada uma destas metodologias irá ser estudado o impacto das estimação de matrizes de covariância através da utilização de métodos clássicos e robustos. Para ajudar na tomada de decisão da escolha do modelo de optimização de carteira, irá ser utilizado um modelo escondido de Markov como indicador do estado do mercado. Por último, os modelos vão ser testados num ambiente de períodos múltiplos nos quais vão ser realizadas realocações dos pesos de cada ativo do portfolio, onde os custos proporcionais da compra e venda são tidos em conta.

Pretende-se que o candidato escreva uma tese de mestrado e que produza material suficiente para submissão de um artigo em revista com avaliação por pares.

Legislação e regulamentação aplicável: Lei n.º 40/2004, de 18 de agosto (Estatuto do Bolseiro de Investigação Científica), na redação que lhe foi dada pelo Decreto-Lei n.º 123/2019, de 28 de agosto; Regulamento de Bolsas de Investigação da IST-ID, disponível em <https://ist-id.pt/concursos/bolsas/> ; Regulamento de Bolsas de Investigação da FCT, disponível em <https://www.fct.pt/apoios/bolsas/docs/RegulamentoBolsasFCT2019.pdf> e <https://dre.pt/application/file/a/127230968>.

Local de trabalho: O trabalho será desenvolvido no(a) CEMAT do IST, sob a orientação científica do(a) Professor(a)/Doutor(a) Cláudia Nunes Philippart.

Duração da(s) bolsa(s): A bolsa terá a duração de 3 meses, com início previsto em dezembro de 2021. A bolsa não é renovável.

Valor do subsídio de manutenção mensal: O montante da bolsa corresponde a €835,98, conforme tabela de valores das bolsas atribuídas diretamente pela FCT, I.P. no País (<http://www.fct.pt/apoios/bolsas/valores>), OU conforme tabela de valores constante do Anexo I do Regulamento de Bolsas de Investigação da IST-ID (<https://ist-id.pt/concursos/bolsas/>), sendo o modo de pagamento da opção do Bolseiro por Transferência Bancária/Cheque.

Métodos de seleção: Os métodos de seleção a utilizar serão os seguintes: Avaliação Curricular, com a respetiva valoração de 100%

Composição do Júri de Seleção: Cláudia Nunes Philippart, Rosário Oliveira e Conceição Amado.

Forma de publicitação/notificação dos resultados: Todos os candidatos serão notificados através de e-mail do Resultado Final da Avaliação.

Prazos e procedimentos de audiência prévia, reclamação e recurso: Após comunicação da lista provisória dos resultados da avaliação, os candidatos dispõem de um período de 10 dias úteis para, querendo, se pronunciarem em sede de audiência prévia de interessados, nos termos dos artigos 121º e seguintes do Código do Procedimento Administrativo. A decisão final será proferida após a análise das pronúncias apresentadas em sede de audiência prévia de interessados. Da decisão final pode ser interposta reclamação para o Júri do concurso, ou recurso para o Presidente da IST-ID, no prazo de 15 dias úteis contados da respetiva notificação.

Prazo de candidatura e forma de apresentação das candidaturas: O concurso encontra-se aberto no período de 12 a 25 de novembro de 2021.

As candidaturas devem ser formalizadas, obrigatoriamente, através do envio dos seguintes documentos: i) Formulário B1 – Candidatura a Bolsa de Investigação (<https://ist-id.pt/concursos/bolsas/>), ii) *Curriculum Vitae*; iii) certificado de habilitações, se aplicável; iv) comprovativo de inscrição em ciclo de estudos conducente à obtenção de grau académico (mestrado, mestrado integrado); v) carta de motivação;

Estes documentos deverão ser enviadas via e-mail para: cnunes@math.tecnico.ulisboa.pt