

(BL41/2021-IST-ID)

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

Bolsa de Investigação para estudante de mestrado

Encontra-se aberto concurso para a atribuição de 1 Bolsa de Investigação, no âmbito do projeto FCT, Análise Estatística Robusta de Dados Financeiros, CEMAT/FARO_PTDC/EGE-ECO/30535/2017 financiado por fundos nacionais através da FCT/MCTES (PIDDAC), nas seguintes condições:

Área Científica: Matemática- Probabilidades e Estatística

Requisitos de admissão: Estar inscrito num mestrado integrado ou num mestrado. Com conhecimentos em Matemática Financeira e Métodos Estatísticos e Data Mining.

Os graus académicos obtidos em países estrangeiros necessitam de registo por uma Instituição portuguesa, de acordo com o Decreto-lei n.º 66/2018, de 16 de agosto, e a Portaria n.º 33/2019, de 25 de janeiro. A apresentação do certificado é obrigatória para a assinatura do contrato. Mais informação poderá ser obtida em: <https://www.dges.gov.pt/pt/pagina/reconhecimento?plid=374>

Plano de trabalhos: Os objetivos particulares a atingir pelo(a) bolseiro(a) são os seguintes:

- Proposta de estimadores robustos para a estimação da volatilidade em dados financeiros. Inicialmente deverá ser efetuada uma revisão bibliográfica sobre o estado de arte relativo a estimadores clássicos de volatilidade, assim como de propostas robustas existentes. O trabalho terá uma componente dedicada ao estudo e comparação dos vários estimadores.
- 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 FCT, disponível em <https://www.fct.pt/apoios/bolsas/regulamento.phtml.pt>

Local de trabalho: O trabalho será desenvolvido no Centro de Matemática Computacional e Estocástica (CEMAT) do Instituto Superior Técnico - Campus Alameda, Universidade de Lisboa, com instalações no Departamento de Matemática sob a orientação científica das Professoras Isabel Rodrigues e Conceição Amado.

Duração da(s) bolsa(s): A bolsa terá a duração de 6 meses, com início previsto em abril de 2021. O contrato de 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>), 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, Isabel Alves Rodrigues 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 reclamação e recurso: Da decisão final pode ser interposta reclamação no prazo de 15 dias úteis, ou recurso para a Direção da IST-ID no prazo de 30 dias úteis, ambos após a respetiva notificação

Prazo de candidatura e forma de apresentação das candidaturas: O concurso encontra-se aberto no período de 1 a 15 de abril de 2021.

As candidaturas devem ser formalizadas, obrigatoriamente, através do envio dos seguintes documentos: i) Formulário B1 – Candidatura a Bolsa de Investigação (<http://drh.tecnico.ulisboa.pt/bolseiros/formularios/>), 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 enviados via e-mail para: irodrig@math.tecnico.ulisboa.pt