

PROPUESTA DE TRABAJO FIN DE MÁSTER (Modalidad B)
Curso 2019-2020
MÁSTER EN TÉCNICAS ESTADÍSTICAS

Título	Desarrollo de Técnicas de Valoración de Capital Económico de entidades Bancario (Economic Risk Value).
Nombre Empresa	Abanca
Tutor/a en la empresa	Sabela Rodriguez Calvo
Director/a	Lino del Valle González
Descripción del trabajo a realizar	<p>Desarrollo de metodologías de valoración avanzadas (tipo VAR, etc.) para que la Entidad pueda hacer estimaciones de capital económico ajustada al riesgo. Objetivos:</p> <ul style="list-style-type: none">• Capacidad de asignación eficiente de capital, importante para tomas de decisión de inversión.• Optimización riesgos por unidades de negocio.• Estimación de precios sensible a la expected and unexpected loss de los productos contratados por clientes <p>Estimación Interna de:</p> <ul style="list-style-type: none">• Correlación de pérdidas entre tipología de operaciones y de clientes.• Probability Density Function of Credit Losses interna.• Duración Finaciera de los instrumentos financieros.
Recomendaciones	
Fechas de las prácticas	Preferiblemente a partir de Septiembre 2019
Lugar de trabajo y horario	Preferentemente Vigo. Se podría valorar asistencia a oficinas 1-2 días semana a Vigo y trabajar desde oficinas Coruña.
Convenio/contrato (tachar lo que no corresponda)	Pendiente de firma de convenio.
Otras observaciones	