

PROPUESTA DE TRABAJO FIN DE MÁSTER (Modalidad B)
Curso 2022-2023
MÁSTER EN TÉCNICAS ESTADÍSTICAS

Título	Desarrollo de un Early Redemption Model
Nombre de la Empresa	ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA S.A.
Tutor/a en la empresa	Carlos Amor Montañés – Validación de Modelos
Tutor/a académico/a	Javier Tarrío y Salvador Naya
Descripción del trabajo a realizar	<p>Detalle del Proyecto: Desarrollo de un modelo estadístico para estimar el efecto de las cancelaciones anticipadas en instrumentos financieros vinculados principalmente a depósitos a plazo de clientes para la gestión del riesgo de tipo de interés de una Entidad Bancaria (según la capacidad y tiempos se podría extender a más tipologías de instrumentos financieros y/o modelos de comportamiento).</p> <p>Tareas del Proyecto:</p> <ul style="list-style-type: none">● Trabajar en el estudio del comportamiento de esos instrumentos.● Evaluar el impacto del entorno macroeconómico en el comportamiento.● Valorar distintos enfoques metodológicos seleccionando la mejor alternativa.● Posibles Benchmarks de mercado en base a estudios similares.
Recomendaciones	<p>Capacidades analíticas y de resolución de problemas matemáticos y estadísticos.</p> <p>Se valorarán conocimientos de estadísticas y modelización (Python, R, Stata...).</p> <p>Se valorarán conocimientos en Economías y Finanzas.</p> <p>Interés por desarrollarse en el campo de las finanzas cuantitativas y los modelos de riesgos.</p>

	Capacidad de trabajo y autonomía en labores de investigación.
Fechas de las practicas	A convenir con el alumno/a seleccionado/a.
Lugar de trabajo y horario	De lunes a viernes de 09.00 a 14.30
Convenio	Convenio de colaboración entre a Universidade de Santiago de Compostela, a Universidade de Vigo, a Universidade da Coruña e ABANCA Corporación Bancaria S.A., para la realización de prácticas de alumnos/as do Máster Universitario en Técnicas Estadísticas.
Otras observaciones	El alumno se incorporará a la Entidad en calidad de Estudiante en Prácticas. Estas prácticas están remuneradas