

PROPUESTA DE TRABAJO FIN DE MÁSTER (Modalidad B)
Curso 2025-2026
MÁSTER EN TÉCNICAS ESTADÍSTICAS

Título	Auditoría de modelos estadísticos en entornos financieros.
Nombre de la Empresa	ABANCA CORPORACIÓN BANCARIA S.A.
Tutor/a en la empresa	Hugo Antonio Díaz De Vita - Responsable Auditoría de modelos
Tutor/a académico/a	Salvador Naya Fernández y Javier Tarrío Saavedra
Descripción del trabajo a realizar	<p>El área de Auditoría de modelos es la unidad encargada de auditar el funcionamiento y uso de los modelos estadísticos del banco.</p> <p>El Trabajo de Fin de Máster (TFM) se definirá conjuntamente, alineando los intereses académicos del estudiante con los proyectos de auditoría disponibles en el momento de la incorporación.</p> <p>Las principales líneas de trabajo serán la revisión de los siguientes modelos estadísticos:</p> <ul style="list-style-type: none">● Modelos de Scoring/Rating empleados el proceso de admisión de operaciones.● Modelos de Parámetros de Riesgo de Crédito (PD, LGD, CCF)● Modelos econométricos y de proyección de variables de negocio, utilizados en el proceso de planificación estratégica del banco <p>A través de su participación, el alumno realizará las siguientes tareas:</p> <ul style="list-style-type: none">● Extracción, transformación y análisis de bases de datos internas del banco.● Réplica de algoritmos de selección de modelos.● Diseño y ejecución de pruebas estadísticas para la validación de hipótesis subyacentes y rendimiento del modelo.● Diseño y aplicación de métricas y controles estadísticos para asegurar la integridad, consistencia y precisión de la información.● Contraste y análisis de resultados de las áreas para garantizar el performance de los modelos.

	<ul style="list-style-type: none"> • Análisis de normativa bancaria y <i>papers</i> de investigación académicos y sectoriales de modelos estadísticos. <p>Durante las prácticas se proporcionará formación en las principales herramientas del banco (SQL, SAS, R).</p> <p>Como resultado, el alumno podrá aplicar técnicas estadísticas y econométricas a problemas de negocio sobre las bases de datos internas.</p>
<p>Recomendaciones</p>	<p>Habilidades cuantitativas para aplicar la teoría en la resolución de problemas matemáticos y estadísticos.</p> <p>Se valorará conocimientos de estadísticas y modelización (Python, R, SAS) y técnicas de tratamiento de datos (SQL, VBA).</p> <p>Se valorarán conocimientos en Economías y Finanzas.</p> <p>Interés por desarrollarse profesionalmente en el ámbito de las finanzas cuantitativas, la gestión/validación de modelos de riesgos o la ciencia de datos aplicada al sector financiero</p> <p>Capacidad de trabajo en equipo en un entorno colaborativo</p> <p>Habilidades de comunicación (oral y escrita).</p> <p>Iniciativa y curiosidad intelectual para investigar, asimilar y aplicar técnicas cuantitativas y herramientas analíticas avanzadas para el sector financiero, comprendiendo su adecuación y limitaciones dentro del marco regulatorio vigente.</p>
<p>Fechas de las practicas*</p>	<p>A convenir con el/la alumno/a seleccionado/a.</p>
<p>Lugar de trabajo y horario*</p>	<p>A Coruña - De lunes a viernes de 09.00 a 14.30.</p>
<p>Prácticas remuneradas</p>	<p>Marca con una x:</p> <p>Sí <input checked="" type="checkbox"/> X</p> <p>No <input type="checkbox"/></p>
<p>Convenio</p>	<p>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.</p>

Otras observaciones	El alumno/a se incorporará a la Entidad en calidad de Estudiante en Prácticas. Estas prácticas están remuneradas con 800 € / brutos al mes.
----------------------------	---

* Campo obligatorio para prácticas no remuneradas