

18th Winter school on Mathematical Finance (Verslag)

Volgend op eerdere edities is van 21 t/m 23 januari 2019 de achttiende winterschool op het gebied van de Financiële Wiskunde georganiseerd. De vorige veertien winterscholen hadden dermate veel enthousiaste reacties opgeleverd, dat ook nu weer op voldoende belangstelling gerekend kon worden. Het aantal deelnemers was aanzienlijk hoger dan in de voorgaande jaren, meer dan zeventig, met een hoge deelname uit het buitenland. Adverteren op internationale fora heeft hier een belangrijke rol in gespeeld. Ook was er weer meer belangstelling uit het bedrijfsleven. Belangrijk is dat een groot deel van de deelnemers nog aan het begin van hun academische carrière staat (promovendi, post-docs), hetgeen het karakter van de bijeenkomst als een ‘school’ versterkt. De grote buitenlandse deelname is mede het gevolg van de goede reputatie die de winterschool in de loop der jaren ook in het buitenland heeft opgebouwd.

De thema's van de winterschool waren deze keer ‘Rough volatility’ en ‘Long term investments’. Het programma van de winterschool bestond voor een belangrijk gedeelte uit twee minicursussen gegeven door Jim Gatheral (The City University of New York) en Paolo Guasoni (Dublin City University), beiden zeer prominente vertegenwoordigers van het vakgebied. Daarnaast waren er drie speciale voordrachten door Jean-Philippe Bouchaud (Capital Fund Management and Académie des Sciences), Stéphane Crépey (Université d'Évry) en Roger Lord (Cardano), eveneens onderzoekers met een gedegen reputatie. Het programma werd verder aangevuld met vier korte voordrachten door onderzoekers aan Nederlandse instellingen.

Bijna zonder uitzondering werden de programma-onderdelen bijzonder gewaardeerd door de deelnemers. Dit bleek onder meer uit de levendige discussies tijdens en na de lezingen en andere gesprekken in informele sfeer en bovendien uit de resultaten van de enquête die onder de deelnemers gehouden is. Bovendien bleek dat er ook weer veel potentiële belangstelling voor een volgende winterschool bestond.

De conclusie is dat ook deze winterschool weer een uitgesproken succesvol wetenschappelijk evenement is gebleken. De organisatie is voornemens om aan het begin van 2020 opnieuw een winterschool op het gebied van de Financiële Wiskunde te houden, met een andere keuze van de speciale onderwerpen. De voorbereidingen hiervoor zijn reeds in gang gezet.