

Quant Commissie

Doelstelling:

Het bieden van een platform voor leden van CFA Society Nederland om kwantitatief beleggingsonderzoek uit te wisselen. Dit kan worden gedaan door externe sprekers uit te nodigen en deze sessies open te stellen voor andere leden, of door het bespreken van onderzoek van commissieleden zelf. Sommige commissieleden waren ook juryleden voor de European CFA Quant Awards vorig jaar.

Binnen de vakgebieden van de commissies binnen CFA Society Nederland worden al veel kwantitatieve technieken gebruikt. Hier ligt de nadruk op het gebruik van deze technieken. Onze commissie is bedoeld voor specialisten die willen "dubbelklikken" op kwantitatieve technieken en onder de motorkap willen kijken.

Het begin in het begin van 2020 viel samen met het begin van Corona. Aanvankelijk was het plan om meerdere keren per jaar bijeen te komen om onderzoek te bespreken en externe sprekers uit te nodigen. Vanwege Corona waren er tot nu toe uitsluitend online webinars. Het webinarformaat maakt het ook gemakkelijk om sprekers uit het buitenland te krijgen. In de toekomst zullen de seminars weer offline plaatsvinden.

Eerdere seminars (zie <https://cfasociety.nl/en/past-events> voor details)

- 28 november 2022: De kruising van risico en opbrengsten. Simon Rottke, Universiteit van Amsterdam
- 30 juni 2022: Het bouwen van een factor model voor bedrijfsobligaties, Alan Langoworthy, Qontigo
- 31 maart 2022: Een introductie tot causale AI, Ben Steiner, causaLens
- 6 juli 2021: Duurzaam multi-factor obligatiebeleggen Joe Hanmer, Ilia Chelomianski, Lucette Yvernault (Fidelity International).
- 11 mei 2021, Ontleden van neerwaarts risico, Rogier Quaadvlieg, Erasmus Universiteit
- 1 april 2021, Een diepgaande analyse van waarde en multi-factor beleggen, Wei Dai, Dimensional
- 18 maart 2021, Perspectief op premie in aandelen, Wei Dai, Dimensional
- 2 februari 2021 Risico onder parameteronzekerheid en prijsbeweging, Anish Shah, Investment Grade Modeling

Meedoen in de organisatie

De commissie staat open voor nieuwe leden. We kunnen wat hulp gebruiken bij het vinden van goede onderwerpen en sprekers. Leden moeten actieve quants zijn met een netwerk in zowel de praktijk als de

wetenschap. Denk aan kwantitatieve specialisten die werkzaam zijn in de beleggingsindustrie (vermogensbeheerders, risicomangers, hedgefondsmanagers). Bob Jansen wil ook juryleden werven voor de European Quant Awards onder de commissieleden. Misschien kunnen we in de toekomst ook weer onderzoek van leden bespreken tijdens een offline bijeenkomst. Momenteel zijn er geen leden uit de high frequency hoek. Mocht je geïnteresseerd zijn, neem dan gerust contact op met [Pieter Jelle \(pjvandersluis@xs4all.nl\)](mailto:pjvandersluis@xs4all.nl) , [Bob \(bobjansen@gmail.nl\)](mailto:bobjansen@gmail.nl) of het kantoor van [CFA Society Netherlands \(office@cfasociety.nl\)](mailto:office@cfasociety.nl)!

Pieter Jelle van der Sluis (Voorzitter)

Bob Jansen, CFA (Secretaris)

Anisa Salomons

Mark Voermans, RBA

Fouad el Kanfoudi, RBA

Tim Kruis, RBA

Chunmei Lin, CFA

Laatste update: 12 april 2023