

شانزدهمین کنفرانس آمار ایران

۲ الی ۴ شهریور ۱۴۰۱، دانشگاه مازندران

پنج کتاب اینسرتوی (Incerto) نسیم طالب

مروری بر دیدگاه فلسفی از «عدم اطمینان» در نوشته‌های این استاد مالی

نسیم نیکولاس طالب آماردان ریاضیدانی است که در حوزه ریسک و اختیار معامله^۱ کار می‌کند. وی عمیقاً به حوزه تصادفی بودن، احتمالات و عدم اطمینان علاقه‌مند است. این فعال بازارهای مالی و در عین حال استاد دانشگاه‌های ماساچوست، مدرسه بازرگانی لندن و دانشگاه آکسفورد، ایده‌ها و نظریه‌های شگرفی دارد که ریشه در آمار دارند و به حوزه مالی توسعه یافته‌اند.

پنج کتاب وی در فاصله ۱۸ سال بین سال‌های ۲۰۰۱ تا ۲۰۱۸ نوشته شده است؛ همه این کتاب‌ها مسئله عدم اطمینان را از دیدی فلسفی بررسی می‌کنند. نسیم طالب آماردانی است که در بازارهای مالی فعال است و عمیقاً به مسئله عدم اطمینان فکر می‌کند؛ وی تلاش می‌کند که مالی ریاضی را از این طریق توسعه دهد.

در این ارائه، پنج کتاب او که تحت عنوان عمومی تر Incerto مطرح شده، مرور خواهد شد. عناوین این پنج کتاب به شرح زیر است:

- شیفته تصادفی بودن،
- قوی سیاه،
- پادشکننده،
- تخت پروکستوس،
- و پوست در بازی.

نسیم طالب می‌کوشد تا نشان دهد که چگونه می‌توان از طبقه خاصی از حوادث تصادفی، از خطاها و از تلاطم بازارها برای کسب و کارها سود گرفت. وی به عنوان یک مالیچی ریاضیدان، به عنوان مدیر صندوق سرمایه‌گذاری حفظ ارزش موفق، و به عنوان معامله‌گر مشتقات^۲ مالی نشان می‌دهد که چگونه از بحران‌های اقتصادی نیز می‌توان سود بدست آورد. وی در چند نوبت با نوشتن مقالاتی علل شکل‌گیری بحران‌هایی مثل بحران بورس NASDAQ در سال ۲۰۰۰ و بحران سال ۲۰۰۷ بازارهای مالی را توضیح داد و در عین حال خود در بازار سرمایه کوشید تا با توسعه نظریه‌هایی مرتبط با شرایط بحران، از این بحران‌ها سود بگیرد

¹ option

² derivatives

سخنران خواهد کوشید تا با معرفی آماردان - ریاضیدانی برجسته که در حوزه اجرایی و نظری اقتصاد مالی بسیار موفق بوده، و مدیر صندوق سرمایه گذاری حفظ ارزش³ معتبری هم در بازارهای سرمایه دنیا بوده، نشان دهد که چگونه طالب از عمیق ترین مفاهیم آماری و ریاضی برای پیشبرد کار خود در عرصه علم مالی استفاده می کند. هم چنین نشان دهد که چگونه به عنوان یک استاد آمار و ریاضی با بررسی عمیق ترین مفاهیم در حوزه آمار، یعنی پرداختن به فلسفه تصادفی بودن و حوادث تصادفی، می کوشد تا دو علم آمار و مالی را همزمان ارتقاء دهد. در این ارائه سخنران خواهد کوشید تا از لابه لای پنج کتاب معروف وی تصویری از تفکرات این اندیشمند را ارائه کند و نشان دهد که دو حوزه از علم، یعنی آمار و مالی، تا چه حد در ارتباط با یکدیگر و همبسته با همدیگرند.

حسین عبده تبریزی

³ hedge fund