

# Jonge econoom wint wetenschapsprijs

Roger Laeven (1979) won de Christiaan Huygens Wetenschapsprijs 2007. De prijs, mede gesponsord door DNB, kreeg de econoom voor zijn proefschrift over financiële risico's. Laeven vertelt over risicomaatstaven en onderlinge afhankelijkheden tussen risico's.

Nicole Paehlig

Minister Plasterk van OC&W reikte op 18 oktober de Christiaan Huygens Wetenschapsprijs 2007 uit aan dr. Roger J.A. Laeven. Laeven kreeg de prijs voor zijn proefschrift *Essays on Risk Measures and Stochastic Dependence. With applications to insurance en finance*. Dit proefschrift verdedigde hij cum laude aan de Universiteit van Amsterdam in 2005. De jury prees in het bijzonder de relevantie van het proefschrift voor de praktijk.

Laeven, thans werkzaam als universitair hoofddocent Econometrie en Actuarieel aan de Universiteit van Tilburg, licht zijn proefschrift toe: 'Het bestaat uit twee delen. Het eerste deel gaat over de vraag welke risicomaatstaven je het beste kunt toepassen in specifieke economische situaties, bijvoorbeeld als je de hoeveelheid solvabiliteitskapitaal wilt vaststellen. Hoe meet je het risico en hoe kun je de risicomaatstaven wetenschappelijk rechtvaardigen? In mijn proefschrift geef ik daar antwoorden op.'

Deel twee gaat over stochastische afhankelijkheid: het verschijnsel dat bepaalde zaken elkaar beïnvloeden, zoals marktrisico en kredietrisico. 'Veel risico's waar financiële instellingen mee te maken hebben, hangen samen,' vertelt Laeven. 'Als er op het ene risicogebied iets aan de hand is, wat betekent dat dan voor het andere risicogebied? Het modelleren van die afhankelijkheid is een groot probleem in de financiële wereld. Hoe doe je dat precies? Ik heb wiskundige modellen bestudeerd voor de samenhang tussen de risico's en er resultaten over afgeleid. Die resultaten maken het mogelijk om bijvoorbeeld de totale hoeveelheid solvabiliteitskapitaal voor een financiële instelling, voor alle risicogebieden tezamen, te berekenen. In mijn proefschrift schets ik ook andere toepassingen voor die modellen, zoals het bepalen van de optimale beleggingsportefeuille.'

Bij het winnen van een prestigieuze prijs gaat het natuurlijk vooral om de erkenning en de eer, maar zo'n geldbedrag is mooi meegenomen. Heeft Laeven daar al een goede bestemming voor gevonden? 'Ik ben een groot liefhebber van muziek. Tijdens mijn studie heb ik een tijd aan het conservatorium gestudeerd. Waarschijnlijk wordt het een piano. Of misschien een vleugel.' ●



De Christiaan Huygens Wetenschapsprijs wordt sinds 1998 toegekend aan een onderzoeker die in een recent verdedigde dissertatie een vernieuwende bijdrage aan de wetenschap heeft geleverd, met bij voorkeur een duidelijk maatschappelijke relevantie. De prijs bestaat uit een belastingvrij geldbedrag van tienduizend euro, een bronzen beeld van Christiaan Huygens en een oorkonde. De jury wordt jaarlijks samengesteld door de Koninklijke Nederlandse Akademie van Wetenschappen.

De prijs beoogt de contacten tussen universiteiten en bedrijfsleven te bevorderen en de instroom van studenten in de bètawetenschappen positief te beïnvloeden. Daarbij gaat het om vijf wetenschapsgebieden, die zich mede door het werk van Christiaan Huygens (1629-1695) hebben kunnen ontwikkelen: actuariaat en econometrie; natuurkunde; ruimtewetenschappen; informatie- en communicatietechnologie; en economie. Jaarlijks staat een van deze wetenschapsgebieden centraal; dit jaar is dat actuariaat en econometrie.

De kosten van de organisatie en prijsuitreiking worden gesponsord door de Nederlandsche Bank, Nationale Nederlanden, Universiteit Utrecht, TNO en European Space Agency (Estec).