



dr hab.  
Rafał Weron,  
prof. PWR

Obrazy. Referuje Tomasz Kludka (EDF Trading, Londyn, Wielka Brytania)

# Matematycy z energią

**K**onferencja *The Energy Finance Christmas Workshop (EFC11)* odbyła się 19-20 grudnia 2011 r. na Wydziale Informatyki i Zarządzania PWR. Było to kameralne spotkanie poświęcone najnowszym osiągnięciom w dynamicznie rozwijającej się dziedzinie *Energy Finance* (w wolnym tłumaczeniu: „Finanse w energetyce”). Organizatorem konferencji był Instytut Organizacji i Zarządzania (I-23).

– Na pomysł zorganizowania konferencji wpadłem niecałe trzy miesiące wcześniej – mówi dr hab. Rafał Weron, prof. PWR – gdy się okazało, że dwóch moich zagranicznych współpracowników przyjedzie do Wrocławia w tym samym czasie, tuż przed Bożym Narodzeniem. Szkoda było nie wykorzystać okazji i nie zachęcić

większej liczby naukowców do odwiedzenia Wrocławia.

Ze względu na krótkie terminy nie było czasu na występowanie o finansowanie do zewnętrznych sponsorów. Ostatecznie została przyjęta prosta formuła – „minimum formalności, minimum kosztów” – brak komitetu organizacyjnego, brak opłat konferencyjnych, brak materiałów konferencyjnych, bez zwracania kosztów hotelu i dojazdu zaproszonym gościom. Skorzyszaliśmy jedynie z pomocy finansowej Instytutu Organizacji i Zarządzania, który zasponsorował przerwy kawowe, oraz z uprzejmości dziekana Wydziału Informatyki i Zarządzania, który udostępnił salę i zaprosił uczestników konferencji na wydziałową Wigilię.

Wśród zaproszonych gości znaleźli się zarówno naukowcy, jak i przedstawiciele biznesu. Przyjechali do Wrocławia niemal z całego świata – z Australii, Austrii, Francji, Japonii, Niemiec, Norwegii, Polski, Wielkiej Brytanii oraz Włoch.

– Jak na konferencję organizowaną w Polsce, mieliśmy wyjątkowo międzynarodowe towarzystwo – komentuje prof. Weron. – Ponad połowa uczestników przyjechała z zagranicy. Bardzo cieszył mnie również aktywny udział najmłodszego pokolenia naukowców – naszych doktorantów i magistrantów. To przecież właśnie oni w najbliższych latach będą wpadać na genialne pomysły i publikować artykuły w najlepszych czasopismach.

Tematyka wykładów pokryła niemal całe spektrum dziedziny (w polskiej nomenklaturze: specjalności naukowej) nazywanej na świecie *Energy Finance*. W ramach czterech sesji tematycznych: I. *Earth, wind, water and fire*,



Wystąpienie Takashiego Kanamury (J-Power, Tokio, Japonia)



Dyskusje podczas przerwy kawowej. Na pierwszym planie od lewej: Angelica Gianfreda (EUI, Florencja, Włochy), Sjur Westgaard (NTNU, Trondheim, Norwegia) i Katarzyna Maciejowska (I-23, PWR)

II. *Crystal ball and beyond*, III. *Risky pricing and hedging* oraz IV. *The incredible world of modeling* dyskutowano m.in. o: handlu emisjami CO<sub>2</sub>, inwestycjach w farmy wiatrowe, modelowaniu rynku transportu morskiego, prognozowaniu pików cen energii elektrycznej, modelowaniu cen towarów z wykorzystaniem modeli przełącznikowych i stochastycznej zmienności, zastosowaniach regresji kwantylowej w zarządzaniu ryzykiem, filtrowaniu i odsezonowywaniu danych rynkowych oraz o wycenie pogodowych instrumentów pochodnych (prezentacje są udostępnione na stronie internetowej konferencji [www.ioz.pwr.wroc.pl/pracownicy/weron/EFC11.htm](http://www.ioz.pwr.wroc.pl/pracownicy/weron/EFC11.htm)).

Wydaje się, że konferencja była sukcesem. Do tego stopnia, że prof. Stefan Trueck z Macquarie University zakończył swój wykład słowami: – Za rok zapraszam do Sydney na EFC12! ■

Rafał Weron  
Zdjęcia:  
archiwum  
R. Weron