

SAJTÓKÖZLEMÉNY: INNOVATÍV MATEMATIKAI MODELLEK KUTATÁSA

Sikeresen zárult az „Innovatív matematikai modellek kutatása a bázeli banki kockázatok mérésére és tőkekövetelmény számszerűsítésére a piaci, működési, likviditási és másodlagos kockázatok területén; valamint pénzügyi termékek áralakulásának viselkedés-alapú előrejelzése” tárgyú K+F projektünk.

A Loxon Solutions Zrt. és a Nemzetközi Bankárképző Központ Zrt. által alkotott konzorcium 336,5 millió Ft teljes keretösszegben kutatás-fejlesztést valósított meg az Új Széchenyi Terv támogatásával. A projekt a Magyar Kormány támogatásával, a Piacorientált kutatás-fejlesztési tevékenység támogatása (PIAC_13-1-2013-0073) pályázat keretén belül valósult meg.

A projekt keretében kialakított módszertanok jelentős innovációt jelentenek a bázeli banki kockázatok mérésében, kezelésében és a tőkekövetelmény számszerűsítésében.

A létrejött kutatási eredmények olyan kockázatszámítási problémák kezelését teszik lehetővé, melyekre eddig sem a banki gyakorlatban, sem a szakirodalomban nem létezett megoldás. A projekt végtermékei a Loxon Solutions Zrt által nyújtott szoftvermegoldásokban, illetve a Nemzetközi Bankárképző Központ Zrt. által nyújtott Bazel II tanácsadási tevékenységben minden eddiginél pontosabb kockázatszáműsítő és értékelő eszközöket biztosítanak.

A projekt kitűzött céljait elérte, olyan új banki kockázatkezelési módszerek és azokon alapuló matematikai modellek kerültek kidolgozásra, melyek mind a napi banki működés során, mind extrém piaci körülmények között alkalmazhatók a kockázatok feltárására, mérésére és előrejelzésére. A kutatás-fejlesztési tevékenység 2014.01.01-én kezdődött, és 2015.06.30-án sikeresen zárult le. A projekt a Magyar állam támogatásával, a Nemzeti Kutatási, Fejlesztési és Innovációs Alap finanszírozásával valósult meg, melyet a résztvevők saját erővel egészítettek ki.

Kedvezményezett:

