



Pannon Egyetem, Kvantitatív Módszerek Tanszék

A szabályozó kártya (control chart) módszer meghaladása folyamatszabályozásában

Témavezető: Dr. Telcs András

A kutatás rövid ismertetése:

A folyamatszabályozás jól ismert és bevált eszköze a szabályozó kártya. Számos ilyen létezik, közös alapjuk a középérték és a szóródás vizsgálata, illetve a normális eloszlás feltételezése. A pénzügyi kockázat elemzés régóta használja ennek megfelelőjét a VAR azaz a kockázat érték megközelítést. Mára világossá vált, hogy a pénzügyek tekintetében ez az eszköz elégtelen a biztonságos kockázat kezeléshez. Nem számol a ritka, de nagy veszteségekkel, illetve azzal, hogy az eloszlás nem normális, akár szórás sem létezik. A kutatási cél a control chart (szabályozó kártya) módszer revíziója, a kiterjesztés példákon keresztüli bemutatása.

Hallgatók korábbi eredményei:

- 1 TDK I díj, több 2-3 díj
- 1 OTDK II díj
- 4 idegen nyelvű tanulmány
- 10+ jeles diplomadolgozat

Elérhetőség: telcs@gtk.uni-pannon.hu