

**A BME Gazdaság és Társadalomtudományi Karán**

**2020. november 12-én megtartott**

**Közgazdaságtan szekcióban**

**A Heller Farkas Alapítvány különdíjában részesült**

**Dolgozat címe: Gazdasági válság elemzése és előre jelezhetősége a valutaárfolyamok rejtett információi alapján**

**Szerző: Erős Gábor a GPK Mechatronikai mérnöki mesterszakhallgatója**

**Konzulens: Dr. Kovács Edith Alice egyetemi docens, Differenciálegyenletek Tanszék**

A dolgozat rövid kivonata\*

A 2008-ban bekövetkezett pénzügyi válság után számos kritika érte a pénzügyi szakértőket, mivel sokak szerint a válság előre jelzése, illetve a védelmi stratégia kidolgozása az ő feladatuk lett volna. Ennek ellenére sokan azon a véleményen vannak, hogy a válságot nem is lehetett volna tisztán az adatokból előre jelezni, mivel az okok sokkal összetettebbek, melyek mind a politikai, a szociológiai és a gazdasági háttér együttesében keresendők.

A válság utólagos elemzésével, az előzményeinek kutatásával számos tudományos munka is foglalkozott, mégis nem született konszenzus, hogy valóban előre jelezhető-e ezek a pénzügyi anomáliás állapotok pusztán a bekövetkezésük előtt meglévő információk alapján.

Jelen kutatásban a pénzügyi válságot, illetve a kialakulásához vezető út vizsgálatát a valutaárfolyamok elemzésén keresztül teszem. A feltételezésem az volt, hogy sok gazdasági és politikai információ megjelenik a valutaárfolyamok idősoráiban és a közöttük lévő kapcsolatokban. A kutatásom ezen információk feltárásával, elemzésével és értelmezésével foglalkozik.

A dolgozatomban egy fejezetet szánok az ilyen irányú kutatások feltérképezésével, rövid bemutatásukkal. A fejezet végén levonok következtetéseket, melyeket a továbbiakban figyelembe veszek. A 2000-2019 valutaárfolyamok idősorait figyelembe véve felhasználtam, illetve kidolgoztam új matematikai modelleket az együttes elemzésükre. Mindegyik modell elméleti leírása után megtalálható valutaárfolyamokon való alkalmazása és gazdasági mutatókkal való összevetése.

Az utolsó előtti fejezet egy kitekintést tartalmaz, amelyben a jelenlegi gazdasági állapotot tárgyalom a bevezetett modellek tükrében, amelyeket összevetek más előrejelzéssel is. A munkámat egy következtetéseket tartalmazó összefoglaló résszel zárom.

\*a TDK dolgozat iránt érdeklődők vegyék fel a kapcsolatot a szerzővel: gaboreros96@gmail.com