

Zastosowanie metod ilościowych w zarządzaniu ryzykiem w działalności inwestycyjnej : praca zbiorowa / pod red. Andrzeja Stanisława Barczaka i Piotra Tworka. – Katowice, 2013

Spis treści

WSTĘP	9
UNIT I	
RISK MANAGEMENT - METHODOICAL APPROACH	
<i>Krzysztof Jajuga</i> INVESTMENT PROCESS IN DYNAMIC FRAMEWORK - MEETING INVESTMENT CRITERIA	13
CHAPTER 1	
METHODS OF RISK ASSESSMENT IN INVESTMENT ACTIVITIES	
<i>Ewa Młynarczyk, Tomasz Węgrzyn</i> APPLYING THE SKEWNESS MODEL ON POLISH STOCK MARKET	25
<i>Rafał M. Łochowski</i> THE GEOMETRIC BROWNIAN MOTION MODEL VS. THE JUMP-DIFFUSION MODEL APPLIED TO SELECTED WIG20 COMPANIES IN THE YEAR 2011	41
<i>Lesław Markowski</i> EMPIRICAL TESTS OF THE CAPM AND D-CAPM MODELS AT THE WARSAW STOCK EXCHANGE	57
<i>Paweł Kliber</i> ESTIMATING SHORT TERM SYSTEMATIC RISK OF STOCK: REALIZED BETAS VS. KALMAN FILTERS	71
<i>Andrzej Stryjek</i> MODELING THE DEPENDENCE OF RISK VARIABLES USING COPULAS. THE COMPARISON OF COPULA PARAMETER ESTIMATION METHODS	86
<i>Piotr Tworek</i> METHODOICAL ASPECTS OF RISK ASSESSMENT IN INVESTMENT PROJECTS IN CONSTRUCTION (SURVEY RESEARCH)	102
CHAPTER 2	
DIFFERENT AREAS OF RISK ASSESSMENT - METHODOICAL APPROACH	
<i>James Carson, Hong Mao, Krzysztof Ostaszewski</i> STOCHASTIC DYNAMIC OPTIMIZATION MODEL OF INSURANCE PRICING UNDER THE ASSUMPTION OF LINEAR DEMAND	115

Jaroslav Belás, Lubor Homolka
USING QUANTITATIVE METHODS ON CREDIT RISK MANAGEMENT
IN THE PROCESS OF BANKING CAPITAL INVESTMENT 140

Jaroslav Sedláček
ANALYSIS AND RISK ASSESSMENT IN THE PROCESS OF MERGERS
AND ACQUISITIONS 152

CZĘŚĆ II
METODY ZARZĄDZANIA RYZYKIEM W DZIAŁALNOŚCI
INWESTYCYJNEJ ORAZ POZOSTAŁEJ DZIAŁALNOŚCI
GOSPODARCZEJ I AKTYWNOŚCI

ROZDZIAŁ 1
KWANTYFIKACJA RYZYKA W INWESTOWANIU NA RYNKU
KAPITAŁOWYM

Tadeusz Czernik
CZAS PRZEBYWANIA - POTENCJALNE ZASTOSOWANIA. GEOMETRYCZNY
RUCH BROWNA 173

Renata Dudzińska-Baryła, Donata Kopańska-Bródka
KUMULACYJNA TEORIA PERSPEKTYWY W OCENIE SPÓŁEK GIEŁDY
PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH W WARSZAWIE 189

Ewa Dziwok
MODELOWANIE PREMII ZA RYZYKO W OPARCIU O IMPLIKOWANĄ
STOPĘ FORWARD 204

Piotr Fiszedler, Justyna Kożuchowska
TESTOWANIE WYSTĘPOWANIA WYBRANYCH ANOMALII
KALENDARZOWYCH NA GPW W WARSZAWIE 217

Daniel Iskra
MINIMALNA WARTOŚĆ ZAGROŻONA PORTFELA INWESTYCYJNEGO
- MODEL Z PAMIĘCIĄ JEDNODNIOWĄ 230

Katarzyna Królik-Kołtunik
EFEKTYWNOŚĆ HEDGINGOWEJ STRATEGII DŁUGIEGO KOŁNIERZA
(LONG COLLAR) NA GIEŁDZIE PAPIERÓW WARTOŚCIOWYCH
W WARSZAWIE 246

Jolanta Majda
ZASTOSOWANIE TESTÓW WARUNKÓW SKRAJNYCH W KONSTRUKCJI
PORTFELA INWESTYCYJNEGO 264

<i>Arkadiusz Orzechowski</i> WYCENA OPCJI EUROPEJSKICH ZA POMOCĄ METODY MONTE CARLO - ANALIZA SZYBKOŚCI I DOKŁADNOŚCI OBLICZENIOWEJ	274
<i>Radosław Pastusiak</i> ZASTOSOWANIE VaR W PROCESIE OGRANICZANIA RYZYKA SYSTEMU TRANSAKCYJNEGO NA PRZYKŁADZIE INSTRUMENTÓW POCHODNYCH	297
<i>Anna Rutkowska-Ziarko, Marek Sochoń</i> WYKORZYSTANIE ODLEGŁOŚCI MAHALANOBISA DO DIAGNOZOWANIA OBJAWÓW KRYZYSU NA PRZYKŁADZIE SPÓŁEK BRANŻY BUDOWLANEJ NOTOWANYCH NA GPW W WARSZAWIE	308
<i>Aleksandra Rutkowska</i> KRZYWA AKCEPTOWALNOŚCI STRAT - KRZYWA RYZYKA JAKO ALTERNATYWNE PODEJŚCIE DO MODELOWANIA OGRANICZENIA RYZYKA W PROBLEMIE OPTIMALIZACJI PORTFELA AKCJI	327
<i>Ewa Dziawgo</i> OPCJE KUPNA Z ODSTĘPEM W ZARZĄDZANIU RYZYKIEM	342
<i>Karolina Koziorowska</i> APROKSYMACJA NARZĘDZI WARTOŚCI ZAGROŻONEJ	357
<i>Elżbieta Kubińska, Łukasz Markiewicz</i> WPŁYW NADMIERNEJ PEWNOŚCI SIEBIE NA RYZYKO PORTFELA INWESTYCYJNEGO	375
ROZDZIAŁ 2	
IŁOŚCIOWE ZARZĄDZANIE RYZYKIEM W INWESTOWANIU RZECZOWYM I POZOSTAŁEJ DZIAŁALNOŚCI GOSPODARCZEJ ORAZ AKTYWNOŚCI	
<i>Jan Czempas</i> NAKŁADY INWESTYCYJNE I DOCHODY WŁASNE JAKO OBARCZONE RYZYKIEM KRYTERIA OCENY SKŁONNOŚCI MIAST DO INWESTOWANIA	386
<i>Agata Adamska</i> RYZYO INWESTYCJI W PASJE	409
<i>Oskar Starzeński</i> O DYKTATURZE RYNKÓW FINANSOWYCH, KRYZYSIE POLITYCZNYM, ZAGROŻONEJ DEMOKRACJI I RYZYKU SYSTEMOWYM	423
<i>Stanisław Kluza, Adam Płociński</i> WPŁYW DOŚWIADCZEŃ KRYZYSOWYCH NA DZIAŁANIA NADZORU W POLSCE	436

Jerzy Gwizdała

KREDYTOWE INSTRUMENTY POCHODNE W ZARZĄDZANIU RYZYKIEM
KREDYTOWYM W BANKU

450

Zuzanna Ostraszewska

ANALIZA PROCESU ADEKWATNOŚCI KAPITAŁOWEJ SEKTORA BANKOWEGO
W POLSCE I INNYCH KRAJACH UNII EUROPEJSKIEJ, ZE SZCZEGÓLNYM
UWZGLĘDNIENIEM WYMOGU Z TYTUŁU RYZYKA OPERACYJNEGO

466

Stanisław Barczak

ZASTOSOWANIA MODELI SZARYCH DO PROGNOZOWANIA PROCESÓW
S KSZTAŁTNYCH NA PRZYKŁADZIE PROGNOZY NA ROK AKADEMICKI
2011/2012 LICZBY STUDENTÓW WSZYSTKICH TYPÓW STUDIÓW
W POLSCE

482

Anna Kasznia

PROGNOZOWANIE CEN ENERGII ELEKTRYCZNEJ NA RYNKU DNIA
NASTĘPNEGO PRZY UŻYCIU SZTUCZNYCH SIECI NEURONOWYCH

497

oprac. BPK