

WYKAZ PUBLIKACJI NAUKOWYCH

I. Po uzyskaniu stopnia doktora

MONOGRAFIE NAUKOWE:

1. Krężołek D. (2020): Modelowanie ryzyka na rynku metali, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice, ISBN: 978-83-7875-642-2

ROZDZIAŁY W MONOGRAFIACH NAUKOWYCH

1. Krężołek D. (2020): Czynniki ryzyka dla notowań złota i srebra, [w:] T. Trzaskalik, K.S. Targiel (red.) Modelowanie preferencji a ryzyko '19-'20, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice, s. 215-229
2. Krężołek D. (2020): Application of Hill Estimator to Assess Extreme Risks in the Metals Market, [w:] Classification and Data Analysis. Theory and Applications, "Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization", eds.: Krzysztof Jajuga, Jacek Batóg, Marek Walesiak, Springer Nature Switzerland AG 2020, s. 103-113
DOI: https://doi.org/10.1007/978-3-030-52348-0_7
3. Krężołek D. (2020): Efektywność inwestycji portfelowych na rynku metali bazowych z wykorzystaniem miar ryzyka ekstremalnego, [w:] „Wizualizacja danych i analiza ryzyka”, red. nauk. Grażyna Trzpiot, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2020, s. 42-58
4. Krężołek D., Smyczek S. (2020): Motives of consumers misbehaviour on the market – model approach, [w:] “Consumer Right Protection. Threats and opportunities for enhancing consumer awareness”, red. nauk. Sławomir Smyczek, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2020, s. 156-172
5. Krężołek D., Trzpiot G. (2018): Od analizy danych do innowacyjnych technologii, [w:] „Innowacyjna gospodarka, innowacyjne organizacje, innowacyjni ludzie”, red. nauk. Celina M. Olszak, Grzegorz Głód, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2018, s. 112-132
6. Krężołek D. (2017): The application of data mining methods in modern marketing research, [w:] „Challenges for marketing in 21st century”, red. nauk. Sławomir Smyczek, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2017, s. 49-70
7. Krężołek D. (2015): Modele zmienności klasy GARCH oraz pomiar ryzyka – analiza porównawcza na rynku metali nieżelaznych i szlachetnych, [w:] „Modelowanie wielowymiarowych struktur danych i analiza ryzyka”, red. nauk. Grażyna Trzpiot, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2015, s. 82-100
8. Krężołek D., Majewska J. (2015): Extreme observations in the metal market and their implication for risk measure, [w:] „Modelowanie wielowymiarowych struktur danych i analiza ryzyka”, red. nauk. Grażyna Trzpiot, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2015, s. 50-64
9. Krężołek D., Trzpiot G., Twaróg S. (2015): Analiza i ocena ryzyka w projektach badawczych, [w:] „Modelowanie wielowymiarowych struktur danych i analiza ryzyka”, red. nauk. Grażyna Trzpiot, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice 2015, s. 128-140

ARTYKUŁY NAUKOWE

1. Krężołek, D., Trzpiot, G. (2020): Risk management on the metals market, "Econometrics. Ekonometria. Advances in Applied Data Analysis", 24(2), s. 86-97, DOI: <http://dx.doi.org/10.15611/eada.2020.2.06>
2. Krężołek D. (2018): Testing day of the week effect on precious metals market, "Dynamic Econometric Models", Vol. 18, s. 81-97, DOI: <http://dx.doi.org/10.12775/DEM.2018.005>
3. Krężołek D. (2017): Selected GARCH-type Models on the Metals Market - backtesting of Value-at-Risk, "Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica", Vol. 5, No. 331, s. 185-203, DOI: <http://dx.doi.org/10.18778/0208-6018.331.12>
4. Krężołek D. (2017): Skośność rozkładu a estymacja kwantylowych miar ryzyka - przypadek rynku metali, "Metody Ilościowe w Badaniach Ekonomicznych", Vol. 17, No. 4, s. 624-634,
5. Krężołek D. (2017): The use of value-at-risk methodology in the assessment of investor's risk attitudes on the precious metals market, "Ekonometria. Econometrics", Nr 3 (57), s. 101-112, DOI: <http://dx.doi.org/10.15611/ekt.2017.3.08>
6. Krężołek D. (2017): Wpływ asymetrii rozkładu na estymację kwantylowych miar ryzyka, "Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach", Nr 344, s. 58-75
7. Krężołek D., Cibis A., Dargiewicz G., Kiermasz R., Pastecki M., Skrzydło M., Staszczyszyn I. (2017): Atrakcyjność miasta Katowice – podejście wizualne, "Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach", Nr 344, s. 39-57
8. Krężołek D., Smyczek S. (2017): Role of social values in determining the attitudes towards consumer's pathological behavior on market. Model-based approach, "Annales Universitatis Mariae Curie-Skłodowska. Sectio H, Oeconomia", Vol. 51, No. 2, s. 133-141, DOI: <http://dx.doi.org/10.17951/h.2017.51.2.133>
9. Krężołek D., Trzpiot G. (2017): The Application of the GlueVaR Measure in Risk Assessment on the Metal Market, "Archives of Data Science, Series A", Vol. 2, No. 1, s. 1-17, DOI: <http://dx.doi.org/10.5445/KSP/1000058749/20>
10. Krężołek D., Trzpiot G. (2017): The Effectiveness of the GlueVaR Risk Measure on the Metals Market – the Application of Omega Performance Measure, "Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica", Vol. 5, No. 331, s. 153-167, DOI: <http://dx.doi.org/10.18778/0208-6018.331.10>
11. Krężołek D. (2016): Model regresji grzbietowej i jego wykorzystanie do oceny ryzyka inwestycyjnego – przypadek rynku metali, "Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach", Nr 288, s. 21-32
12. Krężołek D. (2016): The GlueVaR risk measure and investor's attitudes to risk – an application to the non-ferrous metals market, "Statistics in Transition. New Series", Vol. 17, No. 2, s. 305-316
13. Krężołek D. (2015): Analiza porównawcza ryzyka ekstremalnego na rynkach metali nieżelaznych i szlachetnych, "Metody Ilościowe w Badaniach Ekonomicznych", T. 16, Nr 3, s. 202-2013
14. Krężołek D. (2015): Analiza ryzyka inwestycji na przykładzie wybranych dodatków stopowych, "Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach", Nr 241, s. 65-77
15. Krężołek D. (2015): The application of alpha-stable distributions in portfolio selection problem – the case of the metal market, "Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach", Nr 247, s. 57-67

16. Krężołek D. (2015): Weryfikacja testów zgodności na rynku metali szlachetnych, „Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach”, Nr 219, s. 53-64
17. Krężołek D. (2015): Volatility and risk models on the metal market, „Prace Naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu”, Nr 381, s. 142-157
18. Krężołek D. (2014): Miary zależności – analiza statystyczna na przykładzie wybranych walorów rynku metali nieżelaznych, „Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach”, Nr 192, s. 59-82
19. Krężołek D., Ganczarek-Gamrot A. (2014): Analiza ryzyka na rynku Nord Pool Spot, „Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach”, Nr 192, s. 44-58
20. Krężołek D. (2013): Metody aproksymacji indeksu ogona rozkładów alfa-stabilnych na przykładzie GPW w Warszawie, „Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach”, Nr 162, s. 21-30
21. Krężołek D. (2013): Non-Classical Risk Measures on the Warsaw Stock Exchange – the application of Alpha-stable distribution, „Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica”, Nr 286, s. 269-276

II. Przed uzyskaniem stopnia doktora

ROZDZIAŁY W MONOGRAFIACH NAUKOWYCH

1. Krężołek D., Majewska J., Trzpiot G. (2010): Rozkłady stabilne i teoria wartości ekstremalnych w analizie portfelowej, [w:] „Wielowymiarowe metody statystyczne w analizie ryzyka inwestycyjnego”, red. nauk. Grażyna Trzpiot, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa 2010, s. 116-163
2. Krężołek D., Trzpiot G. (2009): Pomiar ryzyka finansowego z wykorzystaniem statystycznych modeli rozkładów stabilnych, [w:] „Metody matematyczne, ekonometryczne i komputerowe w finansach i ubezpieczeniach 2007”, red. nauk. Piotr Chrzan, Tadeusz Czernik, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Karola Adamieckiego, Katowice 2009, s. 163-171
3. Krężołek D. (2007): Efekt dnia tygodnia na GPW w Warszawie – analiza statystyczna z wykorzystaniem rozkładów stabilnych, [w:] Uwarunkowania rozwoju społeczno-gospodarczego Polski, red. Balcerzak P.A., Górecka D., Wydawnictwo Adam Marszałek, Toruń 2007, s. 187-198

ARTYKUŁY NAUKOWE

1. Krężołek D. (2012): Granica efektywności portfeli inwestycyjnych a indeks ogona rozkładu stopy zwrotu. Analiza empiryczna na przykładzie GPW w Warszawie, „Prace Naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu”, Nr 254, s. 124-132
2. Krężołek D. (2012): Non-classical measures of investment risk on the market of precious non-ferrous metals using the methodology of stable distributions, „Dynamic Econometric Models”, Vol. 12, s. 89-103, DOI: <http://dx.doi.org/10.12775/DEM.2012.006>
3. Krężołek D., Trzpiot G. (2012): Jednoczynnikowy model Sharpe'a – analiza empiryczna na przykładzie wybranych walorów rynku metali nieżelaznych, „Studia Ekonomiczne. Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach”, Nr 91, s. 99-109
4. Krężołek D. (2010): Kwantylowe oraz koherentne miary ryzyka – analiza empiryczna na rynku metali nieżelaznych z wykorzystaniem rodziny statystycznych rozkładów stabilnych, „Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego. Finanse, Rynki Finansowe, Ubezpieczenia”, Nr 29, s. 433-444

5. Kręzołek D. (2009): Application of M-Garch Model Examining the Volatility of Financial Assets, „Acta Universitatis Lodzianis. Folia Oeconomica”, Nr 228, s. 305-311
6. Kręzołek D. (2009): Pomiar efektywności inwestycji – funkcja Omega: zastosowanie na GPW w Warszawie, „Prace Naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu. Inwestycje finansowe i ubezpieczenia – tendencje światowe a polski rynek”, Nr 60, s. 227-234
7. Kręzołek D., Trzpiot G. (2009): Quantiles ratio risk measure for stable distributions models in finance, „Studia Ekonomiczne. Akademia Ekonomiczna im. Karola Adamieckiego w Katowicach”, Nr 53, s. 109-120
8. Kręzołek D. (2008): Analiza porównawcza rozkładu stóp zwrotu – zastosowanie modeli stabilnych, „Prace Naukowe. Akademia Ekonomiczna w Katowicach. Zarządzanie, finanse, ekonomia: warsztaty doktoranckie '07”, s. 245-253
9. Kręzołek D. (2008): Ocena ryzyka inwestycji portfelowych – miara Omega, „Studia i Prace Wydziału Nauk Ekonomicznych i Zarządzania. Uniwersytet Szczeciński. Inwestowanie na rynku kapitałowym”, Nr 10, s. 493-504
10. Kręzołek D. (2007): Budowa portfeli rynkowych i ocena efektywności inwestycji z wykorzystaniem rozkładów stabilnych, „Prace Naukowe Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego we Wrocławiu. Inwestycje finansowe i ubezpieczenia – tendencje światowe a polski rynek”, Nr 1176, s. 185-192
11. Kręzołek D. (2007): Zastosowanie asymetrycznego rozkładu Laplace’a do budowy portfeli inwestycyjnych na polskim rynku kapitałowym, „Dynamiczne Modele Ekonometryczne”, Wydawnictwo Uniwersytetu Mikołaja Kopernika w Toruniu, Toruń 2007, s. 245-252
12. Kręzołek D., Trzpiot G. (2006): Statystyczna weryfikacja modelu CAPM na przykładzie polskiego rynku kapitałowego, „Zeszyty Naukowe Szkoły Głównej Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie. Ekonomika i Organizacja Gospodarki Żywnościowej”, Nr 60, s. 341-351