

SPIS TREŚCI

Ewa Dziawgo Analiza wrażliwości ceny hybrydowej korytarzowej opcji kupna	5
Krzysztof Echaust Wykorzystanie warunkowego modelu maksimów blokowych do pomiaru <i>Value at Risk</i>	19
Stanisław Heilpern Zależny, złożony proces Poissona – wyznaczanie funkcjonałów składek i miar ryzyka	33
Małgorzata Just Ocena przydatności modeli VaR do szacowania ryzyka inwestycji na rynku metali szlachetnych.....	45
Monika Miśkiewicz-Nawrocka Wpływ liczby „najbliższych sąsiadów” na dokładność prognoz ekonomicznych szeregów czasowych.....	60
Krzysztof Piasecki Rozmyta wartość bieżąca – próba ujęcia aksjomatycznego	70
Paweł Porcenałuk Wpływ efektu dyspozycji na płynność akcji debiutujących w okresie 2005-2012 na GPW w Warszawie	80
Ewa Pośpiech Zastosowanie metody wielokryterialnej do uporządkowania spółek w sytuacji niepełnej informacji liniowej.....	89
Joanna Utkin Miara i odwzorowanie ryzyka <i>forward</i> na rynku skończonym.....	100
Tomasz Wójtowicz Intraday event study. The impact of US macroeconomic news on WIG20	109
Katarzyna Zeug-Żebro Identyfikacja chaosu deterministycznego na podstawie liczby najbliższych sąsiadów	119

SUMMARIES

Ewa Dziawgo Analysis of the hybrid corridor call options price sensitivity	18
Krzysztof Echaust Applying the conditional block maxima model to Value at Risk measurement ..	32
Stanisław Heilpern Dependent, compound Poisson process – computation of insurance premiums and risk measures	44
Małgorzata Just Assessment of the usefulness of VaR models for estimating the investment risk on precious metals market	59
Monika Miśkiewicz-Nawrocka Effect of the number of “nearest neighbors” on the accuracy of economic time series forecasts	69
Krzysztof Piasecki Fuzzy present value – an attempt to axiomatic approach	79
Paweł Porcenałuk The influence of the disposition effect on the liquidity of the IPO in 2005-2012 period	88
Ewa Pośpiech An application of multi-criteria method to build rankings of quoted companies under conditions of linear partial information	99
Joanna Utkin Forward risk measure and application in the finite market model.....	108
Tomasz Wójtowicz Intraday event study. The impact of US macroeconomic news on WIG20	109
Katarzyna Zeug-Żebro The identification of deterministic chaos based on the number of nearest neighbors.....	131