

Spis treści

Wprowadzenie (Jerzy Mika)	9
1. Inwestowanie w wartość a podejście fundamentalne – porównanie wybranych strategii inwestycyjnych (Adrianna Mastalerz-Kodzis)	13
1.1. Wprowadzenie	13
1.2. Strategia inwestowania w wartość	14
1.3. Analiza wybranych modeli wielokryterialnych	15
1.3.1. Bezwzorczowa miara syntetyczna (BMS).....	15
1.4. Porównanie portfeli dla różnych strategii – analiza empiryczna	16
1.5. Podsumowanie	19
1.6. Literatura	20
2. Porównanie portfeli klasycznych skonstruowanych na podstawie rankingu wielokryterialnego (Ewa Pośpiech).....	21
2.1. Wprowadzenie	21
2.2. Metoda AHP i wybrane kryteria	22
2.3. Klasyczny portfel Markowitza po uwzględnieniu rankingów wielokryterialnych	24
2.4. Podsumowanie	29
2.5. Literatura	30
3. Wpływ liczby najbliższych sąsiadów w procesie redukcji szumu losowego na dokładność prognoz ekonomicznych szeregów czasowych (Monika Miśkiewicz-Nawrocka)	31
3.1. Wprowadzenie	31
3.2. Redukcja szumu losowego	32
3.3. Prognozowanie szeregów czasowych – metoda NS	33
3.4. Badania empiryczne	34
3.5. Podsumowanie	37
3.6. Literatura	37

4. Lokalna aproksymacja wielomianowa jako narzędzie identyfikacji chaosu deterministycznego (Katarzyna Zeug-Żebro)	39
4.1. Wprowadzenie	39
4.2. Metoda opóźnień.....	39
4.3. Największy wykładnik Lapunowa	40
4.4. Lokalna aproksymacja wielomianowa.....	42
4.5. Przedmiot i przebieg badania	43
4.6. Podsumowanie	48
4.7. Literatura.....	48
5. Wykorzystanie regresji nieparametrycznej do wyceny wartości nieruchomości (Joanna Trzęsiok)	50
5.1. Wprowadzenie	50
5.2. Analizowany zbiór danych	51
5.3. Metody regresji wykorzystane w analizie.....	53
5.4. Identyfikacja zmiennych istotnych i nieistotnych.....	55
5.5. Model otrzymany metodą POLYMARS	56
5.6. Podsumowanie.....	60
5.7. Literatura.....	60
6. Wielowymiarowe modele zmienności rozwoju gospodarczego wybranych państw UE (Anna Janiga-Ćmiel)	62
6.1. Wprowadzenie	62
6.2. Ogólne założenia wielorównaniowego modelu GARCH	63
6.3. Wymagania stawiane konstrukcji modeli DCC-GARCH i CCC-GARCH	65
6.4. Model BEKK	68
6.5. Czynnikiowy model GARCH	69
6.6. Analiza empiryczna.....	71
6.7. Podsumowanie	74
6.8. Literatura.....	74

7. Analiza głównych składowych czynników ryzyka w usługach informatycznych (Łukasz Wachstiel)	76
7.1. Wprowadzenie	76
7.2. Eksploracyjna analiza czynników ryzyka – wyniki badań.....	76
7.3. Analiza głównych składowych ryzyka usług informatycznych	80
7.4. Podsumowanie	84
7.5. Literatura	85
 Zakończenie	 87