

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. Bezwzorcową miarą syntetyczną (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