SPIS TREŚCI

Część pierwsza: Matematyka finansowa

Marcin BARTKOWIAK
Problemy w implementacji modelu Blacka-Scholesa-Mertona związane z wyznaczaniem współczynnika zmienności 7

Marcin BARTKOWIAK, Edyta SIDOR-BANASZEK
Wykorzystanie obligacji i opcji katastrofalnych do uzupełniania reasekuracji 15

Małgorzata DOMAN
Modelowanie dynamicznych warunkowych korelacji stóp zwrotu na polskim rynku finansowym 33

Małgorzata DOMAN, Ryszard DOMAN
Ocena przydatności modeli BL-GARCH w szacowaniu wartości zagrożonej indeksu WIG20 50

Ryszard DOMAN
Modelowanie i prognozowanie zmienności kursów walutowych za pomocą modeli przełącznikowych typu Markowa 70

Krzysztof ECHAUST
Zabezpieczenia krzyżowe 88

Karolina KALIŃSKA
Rodzaje i dynamika rozwoju funduszy inwestycyjnych w Polsce . 100

Paweł KLIBER
Wycena opcji na akcje w modelu zmienności stochastycznej . . . 121

Krzysztof PIASECKI
Model Mayersa jako narzędzie poszerzania klasy portfeli efektywnych 149

Edyta SIDOR-BANASZEK
Inwestycje zakładów ubezpieczeń na polskim rynku ubezpieczeniowym w latach 2001-2003 a ich sytuacja finansowa 164

Część druga: Ekonomia matematyczna

Paweł KLIBER, Piotr MAĆKOWIAK, Krzysztof MALAGA
Konwergencja i nierówności regionalne w Polsce. Analiza w kategoriach neoklasycznych modeli wzrostu 185

Michał KONOPCZYŃSKI
Znaczenie kapitału ludzkiego w unii monetarnej w świetle neoklasycznego modelu wzrostu gospodarczego 210

Piotr MAĆKOWIAK
O ograniczoności dopuszczalnych procesów wzrostu w modelach wieloproduktowych 249

Część trzecia: Ekonometria i badania operacyjne

Marcin ANHOLCER
Metoda rzutowania gradientu dla nieliniowych zadań alokacji . . 267

Marian MATŁOKA
O pewnych uogólnieniach zbioru wypukłego i funkcji wypukłej . 285

Henryk J. RUNKA
Analiza złożoności i zbieżności w algorytmach punktów wewnętrznych 297

Elżbieta RYCHŁOWSKA-MUSIAŁ
Optymalizacja wartości przedsiębiorstwa w modelu z zapasami . . 320

Zbigniew ŚWITALSKI
Algorytm Gale'a-Shapleya i jego uogólnienie 339