# SPIS TREŚCI

Marcin BARTKOWIAK
Efektywność strategii stochastycznej dominacji na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie ..... 4

Milda BURZAŁA
Próba prognozowania aktywności gospodarczej Polski metodą analogową ..... 13

Małgorzata DOMAN, Ryszard DOMAN
Nieliniowość w szeregach zwrotów akcji notowanych na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie ..... 37

Piotr DWORNICZAK
Wybór portfela papierów wartościowych na podstawie rozkładów możliwości ..... 52

Przemysław GARSZTKA, Maciej KOKORNIAK
Próba wykorzystania analizy kointegracyjnej do określenia powiązania stopy bezrobocia z jakością portfela kredytów konsumpcyjnych banku ..... 63

Michał KAŁDOŃSKI, Jacek MIZERKA
Zastosowanie opcji rzeczywistych do wyceny leasingu operacyjnego 93

Marcin KAMIŃSKI
Czy Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie jest barometrem gospodarki? ..... 111

Paweł KLIBER, Przemysław MATUSZEWSKI
Identyfikacja struktury portfela funduszu inwestycyjnego ..... 129

Jerzy KOWALAK, Tomasz RABIEGA
Próba oszacowania ryzyka wykorzystania wybranych instrumentów polskiego rynku kapitałowego metodą VaR. Na przykładzie wybranych kontraktów terminowych i portfela trójskładnikowego ..... 158

Marek ŁAŻEWSKI, Krzysztof ZATOR
Badanie zwrotów z akcji notowanych w systemie ciągłym na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie z wykorzystaniem rozkładów Pareto-Levy'ego ..... 182

Marian MATŁOKA
Reasekuracja a prawdopodobieństwo ruiny firmy ubezpieczeniowej 217

Przemysław MATUSZEWSKI
Konstrukcja portfela papierów wartościowych z heteroskedastycznym składnikiem losowym ..... 225

Elżbieta RYCHŁOWSKA-MUSIAŁ
Optymalne strategie alokacji kapitału między dwa zakłady jednej firmy ..... 249

Edyta SIDOR-BANASZEK
Rezerwy w ubezpieczeniach na życie ..... 271