SPIS TREŚCI

Część pierwsza: Ekonomia matematyczna

Michał KONOPCZYŃSKI
Model wzrostu małej gospodarki w unii monetarnej. Ujęcie neoklasyczne 7

Piotr MAĆKOWIAK
„Silna" wersja twierdzenia o magistrali w wielosektorowym modelu wzrostu optymalnego typu Leontiefa-Gale'a 43

Krzysztof MALAGA
Konwergencja gospodarcza w krajach OECD w latach 1960-1999. Wyniki badań empirycznych 56

Emil PANEK
Dynamiczna teoria popytu i sterowanie optymalne 94

Elżbieta RYCHŁOWSKA-MUSIAŁ
Wpływ postępu techniczno-organizacyjnego na optymalną strategię alokacji kapitału firmy 121

Część druga: Matematyka finansowa

Marcin BARTKOWIAK
Wykorzystanie opcji do zabezpieczania portfela akcji 149

Małgorzata DOMAN
Rozkłady statystyki BDS standaryzowanych reszt modeli GARCH zwrotów indeksów GPW w Warszawie 162

Małgorzata DOMAN, Ryszard DOMAN
Testowanie nieliniowości w zwrotach indeksów GPW w Warszawie . 179

Ryszard DOMAN
Wykładniki Lapunowa zwrotów indeksów GPW w Warszawie . . . 193

Krzysztof ECHAUST
Optymalne zarządzanie ryzykiem w modelu Blacka-Scholesa 207

Gerard GŁOWACKI
Efektywność inwestycji portfela akcji zbudowanego z wykorzystaniem klasycznego modelu Markowitza 220

Alicja GOŁĘBIEWSKA
Analiza grubości ogona rozkładu stóp zwrotu 230

Paweł KLIBER
O pewnym dowodzie zasadniczego twierdzenia matematyki finansowej w modelu z przeliczalną przestrzenią zdarzeń elementarnych 240

Jerzy MARCINKOWSKI
Ryzyko długoterminowych sekwencyjnych inwestycji giełdowych . . 258

Krzysztof PIASECKI
Metoda CAPM dla portfela pseudogeometrycznych ruchów Browna . . 280

Część trzecia: Badania operacyjne i ekonometria

Piotr DWORNICZAK
Wybrane metody porównywania liczb rozmytych 297

Mariusz GRABIEC, Yoel Je CHO
The Relation of Doubling in Common Fixed Point Theory 311

Monika KACZMAREK, Krzysztof PIASECKI
Zastosowanie współczynnika Giniego do oceny systemu podatkowego . 319

Henryka J. RUNKA
Układy prymalne i prymalno-dualne ograniczeń w optymalizacji ciągłej 338

Wojciech SIKORA
Algorytm indeksowy dla zagadnienia rozdziału z kryterium dochodu . . 361

Zbigniew ŚWITALSKI
O pewnych uogólnieniach metody Bordy 376

Część pierwsza

Ekonomia matematyczna