SPIS TREŚCI

Słowo wstępne (*Witold Jurek*) 5

Marcin BARTKOWIAK
Budowa portfeli neutralnych z wykorzystaniem tak zwanych greckich parametrów 7

Milda BURZAŁA
Kilka uwag na temat wyboru modelu dyskretnego do prognozowania aktywności gospodarczej Polski 19

Małgorzata DOMAN
Dopasowanie modeli GARCH w próbie a jakość otrzymywanych prognoz zmienności 43

Ryszard DOMAN
Asymetria w zwrotach kursów wymiany złotego 66

Piotr DWORNICZAK
Zastosowanie liczb rozmytych klasy *L-R* do określania zaktualizowanej wartości netto inwestycji 85

Przemysław GARSZTKA, Marek ŁAŻEWSKI
Wykorzystanie sieci neuronowych do prognozowania szeregów finansowych o wysokiej częstotliwości, na przykładzie notowań akcji na GPW w Warszawie 95

Bogusław GUZIK
Napływ nowych informacji giełdowych a wolumen obrotów wybranych spółek na GPW w Warszawie w latach 2000-2002 112

Bogusław GUZIK, Filip SZYMCZAK
Skuteczność niektórych prostych procedur prognozowania cen akcji na GPW w Warszawie 131

Paweł KLIBER
O dynamice i rozkładach struktury portfela wielu akcji 158

Maciej KOKORNIAK, Przemysław GARSZTKA
Zastosowanie sieci neuronowych oraz analizy dyskryminacyjnej do tworzenia scoringu behawioralnego ratalnych kredytów konsumpcyjnych 173

Agnieszka LANGNER
Modele strukturalne jako narzędzie zarządzania ryzykiem kredytowym 192

Marek ŁAŻEWSKI
Zastosowanie ultrasferycznej analizy harmonicznej do analitycznego wyznaczania funkcji gęstości prawdopodobieństwa wielowymiarowych α-stabilnych rozkładów prawdopodobieństwa 210

Piotr MAĆKOWIAK
„Bardzo silna" wersja twierdzenia o magistrali w wielosektorowym modelu wzrostu optymalnego typu Leontiefa-Gale'a 235

Jacek MIZERKA
Koncepcje wyceny opcji rzeczywistych 255

Elżbieta RYCHŁOWSKA-MUSIAŁ
Dotacje w przedsiębiorstwie – problem podziału nadwyżki finansowej 273

Edyta SIDOR-BANASZEK
Wpływ rezerw techniczno-ubezpieczeniowych na sytuację finansową zakładów ubezpieczeń 285