



**Modelowanie i Prognozowanie Gospodarki Narodowej**  
**Hotel Astor, Jastrzębia Góra, 28-31 maja 2007 roku**  
**Program Konferencji**

**28.05.2007 (poniedziałek)**

**15.00–18.00** Przyjazd i zakwaterowanie uczestników konferencji  
**18.00–20.00** Kolacja

**29.05.2007 (wtorek)**

**8.00–8.45** Śniadanie

**9.00–9.15** Otwarcie konferencji

**9.20–11.20 Sesja plenarna A: Równowaga makroekonomiczna, wzrost i rozwój gospodarczy**

**Dr hab. Krzysztof Malaga, mgr Krzysztof Cichy** (Akademia Ekonomiczna w Poznaniu)

*Dyfuzja technologii w zagregowanych modelach wzrostu gospodarczego*

**Prof. AE dr hab. Henryk Zawadzki** (Akademia Ekonomiczna w Katowicach)

*Model Solowa-Swana ze zmienną stopą wzrostu populacji*

**Prof. AE dr hab. Maciej Jasiński** (Wyższa Szkoła Bankowa we Wrocławiu)

*Oscylacyjny model wzrostu – przybliżenie drugie*

**Dr Sławomir Dudek** (Szkoła Główna Handlowa w Warszawie)

*Krótkookresowe prognozowanie produkcji sprzedanej przemysłu przetwórczego na podstawie wyników z testu koniunktury*

**Dr Dorota Ciolek, dr Stanisław Umiński** (Uniwersytet Gdański)

*Jak mierzyć wpływ bezpośrednich inwestycji zagranicznych na produktywność przemysłu w Polsce?*

**Dr Bartosz Chorkowy, mgr Marian Drymluch** (Uniwersytet Opolski)

*Wzrost znaczenia kredytu jako źródła finansowania w zaspokajaniu potrzeb mieszkaniowych ludności w Polsce*

**11.20-11.50** Przerwa kawowa

**11.50–13.50 Sesja plenarna B: Równowaga makroekonomiczna, wzrost i rozwój gospodarczy**

**Prof. dr hab. Jan Jacek Sztudynger** (Uniwersytet Łódzki)

*Kapitał społeczny – problemy modelowania i równoważenia wzrostu*

**Prof. dr hab. Andrzej Franciszek Bocian** (Uniwersytet w Białymstoku)

*Problemy modelowania wzrostu gospodarczego*

**Prof. PG dr hab. Jerzy Ossowski** (Politechnika Gdańska)

*Pomiar i interpretacja efektów sezonowych w przyczynowo-skutkowych modelach dynamicznych na przykładzie modelu płac w Polsce*

**Dr Piotr Wdowiński** (Uniwersytet Łódzki)

*Modelowanie i prognozowanie kursu walutowego złoty/euro*

**Dr Lech Kujawski** (Uniwersytet Gdański)

*Realny kurs wymiany złotówki i innych wybranych walut europejskich w perspektywie przystąpienia do strefy euro*

**Dr Jacek Batóg, dr Barbara Batóg** (Uniwersytet Szczeciński)

*Ocena zmian zatrudnienia w krajach Unii Europejskiej z wykorzystaniem analizy shift-share*

**14.00-14.50** Obiad

**15.00-19.00** Wycieczka – zwiedzanie Półwyspu Helskiego

**19.30-20.30** Kolacja

**30.05.2007 (środa)**

**8.00–8.45** Śniadanie

**9.00–10.20** **Sesja plenarna C: Przedsiębiorstwa i gospodarstwa domowe w gospodarce rynkowej**

**Prof. dr hab. Jerzy Witold Wiśniewski** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)

*Ekonometryczny model wpływów pieniężnych w analizie płynności finansowej małego przedsiębiorstwa*

**Dr Iwona Markowicz, dr Beata Stolorz** (Uniwersytet Szczeciński)

*Wykorzystanie modelu proporcjonalnego hazardu Coxa do retrospektywnej analizy czasu funkcjonowania firmy*

**Prof. SGH dr hab. Małgorzata Rószkiewicz, mgr Dorota Węziak** (Szkoła Główna Handlowa)

*Model orientacji przedsiębiorstwa na wiedzę – próba operacjonalizacji*

**Mgr Elżbieta Pankau** (Uniwersytet Gdański)

*Modele stochastycznych preferencji w teorii wyboru w warunkach ryzyka*

**10.20-10.50** Przerwa kawowa

**10.50-13.10** **Sesja plenarna D: Rynek kapitałowy, pieniężny i ubezpieczeniowy**

**Prof. UG dr hab. Tadeusz Witold Bolt, dr Anna Zamojska** (Uniwersytet Gdański)

*Skointegrowany wektorowo-autoregresyjny model aktywów wybranych grup funduszy inwestycyjnych w Polsce*

**Prof. WSIZ dr hab. Zdzisław Cięciwa** (Wyższa Szkoła Informatyki i Zarządzania w Rzeszowie)

*Dwie awersje oraz dwa ryzyka dla dobrowolnych ubezpieczeń majątkowych*

**Dr Ewa Dziawgo** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)

*Model wyceny złożonych opcji wyboru – analiza empiryczna*

**Dr Agnieszka Majewska** (Uniwersytet Szczeciński)

*Weryfikacja zmienności kursów akcji wyznaczonych na podstawie cen opcji*

**Dr Ewa Dziwok** (Akademia Ekonomiczna w Katowicach)

*Modelowanie czynników dyskontowych i ich wykorzystanie do konstrukcji krzywej rynku pieniężnego*

**Dr Patrycja Kowalczyk, dr Ewa Poprawska** (Akademia Ekonomiczna we Wrocławiu)

*Analiza inwestycji na polskim rynku nieruchomości*

**Mgr Bogumiła Wątarek** (Akademia Ekonomiczna we Wrocławiu)

*Wpływ stopy zastąpienia emerytury z części kapitałowej na całkowitą stopę zastąpienia emerytury w zreformowanym systemie emerytalnym w Polsce*

**13.10-14.00** Obiad

**14.45–15.45** **Sesje plakatowe A+B: Równowaga makroekonomiczna, wzrost i rozwój gospodarczy**  
(Bufet z kawą w trakcie sesji)

**Sesja plakatowa A:**

**Mgr Piotr Białowolski** (Szkoła Główna Handlowa w Warszawie)

*Powiązanie między rynkiem kredytowym a konsumpcją*

**Mgr Małgorzata Borzyszkowska** (Uniwersytet Gdański)

*Popyt na pieniądź – przegląd wybranych prac empirycznych*

**Prof. AE dr hab. Józef Biolik** (Akademia Ekonomiczna w Katowicach)

*Wykorzystanie analizy mnożnikowej do oceny wybranych aspektów gospodarki województwa śląskiego*

**Dr Second Bwanakare** (Wyższa Szkoła Informatyki i Zarządzania w Rzeszowie)

*Income distribution and fiscal policy in Gabon: A computable general equilibrium model*

**Dr Jakub Gazda, mgr Marcin Puziak** (Akademia Ekonomiczna w Poznaniu)

*Polski rynek pracy w świetle modelu Hansena*

**Dr Grzegorz Kuczyński** (Uniwersytet Gdański)

*Czy wysoki poziom bezrobocia w Polsce można tłumaczyć występowaniem histerezy?*

**Sesja plakatowa B:****Mgr Janusz Gliński** (Uniwersytet Gdański)*Zastosowanie procesów ARIMA do prognozowania wybranych szeregów czasowych***Dr Konstancja Gogolewska** (Akademia Ekonomiczna we Wrocławiu)*Wybrane aspekty prognozowania wielkości sprzedaży nowych produktów***Prof. UMK dr hab. Tadeusz Kufel** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)*Ekonometryczne modelowanie cykliczności dobowych, tygodniowych, miesięcznych i rocznych dla danych o wysokiej częstotliwości***Mgr inż. Tomasz Ślodziński, mgr Tomasz Pisarek** (Wyższa Szkoła Informatyki i Zarządzania w Rzeszowie)*Zastosowanie modelu wzajemnych oddziaływań oraz wybranych metod taksonomicznych w analizie popytu na usługi hotelarskie***Dr Ewa Szabela-Pasierbińska** (Akademia Ekonomiczna we Wrocławiu)*Prognozowanie wielkości produkcji biopaliwa w Polsce***Dr inż. Krzysztof Świetlik** (Politechnika Gdańska)*Modele popytu na samochody na rynku pierwotnym w Polsce w latach 1999-2006***Mgr Tomasz Węgrzyn** (Akademia Ekonomiczna w Katowicach)*Zmodyfikowana strategia zabezpieczająca delta – ocena efektywności stosowania strategii w latach 1996-2006***16.00-18.20 Sesja plenarna E: Metody statystyki wielowymiarowej i ich zastosowania****Prof. dr hab. Czesław Domański** (Uniwersytet Łódzki)*Testy zgodności oparte na resztach wielowymiarowych modeli regresji***Prof. UMK dr hab. Magdalena Osińska** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)*Wykorzystanie analizy ścieżek do identyfikacji zależności przyczynowych w modelu wpływu impulsów monetarnych na rynek kapitałowy w Polsce***Prof. UG dr hab. Krystyna Strzała** (Uniwersytet Gdański)*Panelowe testy kointegracji – koncepcja i przegląd zastosowań***Dr Joanna Górka** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)*Modele RCA GARCH***Dr Konstancja Gogolewska, dr Jacek Szandula** (Akademia Ekonomiczna we Wrocławiu)*Propozycja sposobu oceny dopuszczalności prognoz sporządzanych metodą  $m$  najmniejszych  $k$ -sympleksów***Dr Kamila Migdał-Najman** (Uniwersytet Gdański)*Analiza podobieństwa wyników grupowania uzyskanych w oparciu o metodę  $k$ -średnich dla wybranych metod ustalania optymalnej liczby skupień***Dr Krzysztof Najman** (Uniwersytet Gdański)*Zastosowanie sieci neuronowej typu SOM do wyboru zmiennych o najwyższym potencjale dyskryminacyjnym***20.00 Uroczysta kolacja****31.05.2007 (czwartek)****8.00–8.45** Śniadanie**9.00–10.00 Sesja plenarna F: Instytucje użyteczności publicznej****Prof. dr hab. Tadeusz Bednarski** (Uniwersytet Wrocławski)*Prognozy popytu w sferze edukacji wyższej – metodologia i analiza danych empirycznych***Dr Marek Biernacki** (Akademia Ekonomiczna we Wrocławiu)*Próba oceny służby zdrowia w Polsce*

**10.15-11.15**      **Sesje plakatowe C+D: Rynek kapitałowy, pieniężny i ubezpieczeniowy**  
(Bufet z kawą w trakcie sesji)

**Sesja plakatowa C:**

**Mgr Janusz Kowalczyk** (Uniwersytet Gdański)

*Wyznaczenie zabezpieczenia wystawianych instrumentów pochodnych z wykorzystaniem programowania dynamicznego*

**Dr Ewa Majerowska** (Uniwersytet Gdański)

*Możliwości prognozowania stóp zwrotu na przykładzie walorów notowanych na GPW w Warszawie*

**Mgr Agnieszka Martynowska** (Uniwersytet Gdański)

*Próba identyfikacji wybranych źródeł ryzyka sektorowego na GPW w Warszawie w latach 1999-2006*

**Prof. UG dr hab. Paweł Milobędzki** (Uniwersytet Gdański)

*Efektywność informacyjna Londyńskiej Giełdy Metali*

**Mgr Sabina Nowak** (Uniwersytet Gdański)

*Krótką sprzedaż na GPW w Warszawie w latach 2002-2007*

**Sesja plakatowa D:**

**Dr Beata Jackowska** (Uniwersytet Gdański)

*Wykorzystanie modeli wielostanowych w ubezpieczeniach życiowych i zdrowotnych*

**Mgr Teresa Plenikowska-Ślusarz** (Uniwersytet Gdański)

*Obciążenie demograficzne i jego implikacje na rozwój społeczny i gospodarczy*

**Mgr Agnieszka Pobłocka** (Uniwersytet Gdański)

*Analiza wypadków komunikacyjnych w Polsce na tle wybranych krajów Unii Europejskiej*

**Prof. dr hab. Mirosław Szreder** (Uniwersytet Gdański)

*Rola statystyki w doskonaleniu jakości badań sondażowych*

**Dr Ewa Wycinka** (Uniwersytet Gdański)

*Analiza czynników różnicujących umieralność ubezpieczonych*

**Dr Jerzy Zemke** (Uniwersytet Gdański)

*Optymalizacja kosztów ubezpieczenia ryzyk działalności organizacji gospodarczej*

**11.30-13.30**      **Sesja plenarna G: Rynek kapitałowy, pieniężny i ubezpieczeniowy**

**Prof. WSIZ dr hab. Zdzisław Cięciwa** (Wyższa Szkoła Informatyki i Zarządzania w Rzeszowie),

**mgr Ewa Libura** (Akademia Górniczo-Hutnicza w Krakowie)

*Warunki stosowania mieszanki rozkładów normalnych w modelu Blacka-Scholesa*

**Dr Piotr Fiszeder** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)

*Prognozowanie VaR – zastosowanie wielorównaniowych modeli GARCH*

**Dr Jacek Kwiatkowski** (Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu)

*Bayesowskie modelowanie indeksu WIG z wykorzystaniem modelu autoregresyjnego z losowymi parametrami*

**Dr Tadeusz Winkler-Drews** (Wyższa Szkoła Przedsiębiorczości i Zarządzania im. Leona Koźmińskiego)

*Efektywność indeksów GPW w Warszawie*

**Dr Sebastian Majewski** (Uniwersytet Szczeciński)

*Porównanie empirycznych rozkładów stóp zwrotu graczy giełdowych płci żeńskiej i męskiej – wyniki badań eksperymentalnych*

**Dr Bartosz Chorkowy, mgr Marian Drymluch** (Uniwersytet Opolski)

*Japońskie metody analizy technicznej i ich wykorzystanie w przewidywaniu ruchów cen na rynku papierów wartościowych*

**13.30-13.45**      **Podsumowanie i zakończenie konferencji**

**13.45**              **Obiad**