

SPIS TREŚCI

Od Redakcji.....	3
Do autorów prac pragnących opublikować je w „Przełęcz Statystycznym”	4
Long N g u y e n - T h a n h - Wycena opcji przy użyciu procesów Levy'ego. Podejście analityczne	7
Joanna U t k i n - Uodpornienie portfela zawierającego obligacje o oprocentowaniu zmiennym.....	31
Hanna D u d e k - Wpływ współliniowości na wartości współczynników korelacji pomiędzy parami zmiennych objaśniających	41
Piotr F i s z e d e r - Testy stałości współczynników korelacji w wielorównaniowym modelu garch - analiza korelacji między indeksami giełdowymi: WIG, DJIA i Nasdaq Composite	53
Joanna B r u z d a - Procesy dwuliniowe i procesy GARCH w modelowaniu finansowych szeregów czasowych.....	73
Michał M a j s t e r e k - Zmienne zintegrowane w stopniu drugim w modelowaniu ekonometrycznym.....	97
Mieczysław K o r a l e w s k i - Analiza logiczna w ekonometrii część I. Problemy do rozwiązania.....	117
Szczepan P e r z - O pewnych związkach programowania liniowego z teorią liczb i teorią grafów	133

SPRAWOZDANIA

Robert K e l m - Trzecie warsztaty doktorskie z zakresu ekonometrii i statystyki	159
Cyprian K o z y r a , Magdalena S i p a - Druga międzynarodowa konferencja na temat badania poziomu życia.....	164