



WARSAW
UNIVERSITY
OF LIFE SCIENCES

INSTITUTE OF ECONOMICS AND FINANCE
DEPARTMENT OF ECONOMETRICS AND STATISTICS



23rd INTERNATIONAL CONFERENCE
ON
QUANTITATIVE METHODS IN ECONOMICS 2022

CONFERENCE PROGRAMME (ON LINE – MS TEAMS)

Warsaw, September 9, 2022

CONFERENCE CHAIRPERSONS:

- dr hab. Hanna Dudek, prof. SGGW (WULS-SGGW) – Chair
- dr hab. Joanna Landmesser, prof. SGGW (WULS-SGGW) – Vice-Chair

CONFERENCE ORGANISING COMMITTEE:

- Monika Zielińska - Sitkiewicz – Chair
- Mariola Chrzanowska – Vice-Chair
- Joanna Landmesser - Rusek
- Paweł Kobus
- Łukasz Pietrych
- Tomasz Woźniakowski
- Ewa Wasilewska
- Dorota Żebrowska - Suchodolska

Department of Econometrics and Statistics, Warsaw University of Life Sciences – SGGW

Nowoursynowska 159 Building: 34, Room: 3/44A

Phone: +48 22 59 37 224

e-mail: konferencja_mibe@sggw.edu.pl

| September 9 - Friday | | | Addresses Teams Sessions: |
|--|---|---|---|
| 9:15-9:30 | Opening the conference | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a535c730ac8dd4469ab9bfd3c51a09ddd%40thread.tacv2/1661942579233?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| Plenary Session 1 - Chair: prof. dr hab. Bolesław Borkowski | | | |
| 9:30-11:00 | Marek Gruszczyński | Badania ekonometryczne w rachunkowości – aktualne nurty | |
| | Ryszard Szupiluk | Identyfikacja ukrytych komponentów w szeregach czasowych metodami nieujemnej faktoryzacji macierzy | |
| | Aleksandra Łuczak, Sławomir Kalinowski | Metody porządkowania liniowego w ocenie subiektywnego ubóstwa gospodarstw domowych – analiza porównawcza | |
| 11:15-13:00 | Parallel sessions: A1 (English), B1 (Polish) | | |
| Session A1 - Chair: prof. dr hab. Marek Gruszczyński | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a55ca74b812c84e3b9228a3ddf2c50a49%40thread.tacv2/1661943224426?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 11:15-13:00 | Paweł Sakowski, Robert Ślepaczuk, Jakub Michańków | Energy, Crypto Assets, Gold, and Soft Commodities as a Safe Haven in Algorithmic Investment Strategies based on Deep Learning and ARIMA-GARCH models for Equity Indices | |
| | Michał Woźniak, Robert Ślepaczuk | LIGHT Benchmark - comprehensive backtesting framework for market risk models comparison | |
| | Marek Kociński | On Trading on the Stock Market in Case of the Liquidity Shortage | |
| | Sedefoğlu Gülşah, Burak Güriş | Testing for cointegration in STAR models: An empirical example from Turkey | |
| Session B1 - Chair: dr hab. Aleksandra Łuczak | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a7f8b46fbbecb4b968fe698f10559e08e%40thread.tacv2/1661943710383?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 11:15-13:00 | Małgorzata Just, Krzysztof Echaust | Efektywność zabezpieczenia inwestycji na amerykańskim rynku akcji podczas pandemii COVID-19 | |
| | Szczepan Urjasz, Renata Karkowska | Identyfikacja mechanizmu transmisji ryzyka na rynkach akcji oraz w indeksach energii odnawialnej i nieodnawialnej na świecie | |
| | Anna Denkowska, Krystian Szczęsny, Stanisław Wanat | Modelowanie zależności w agregacji ryzyka w kontekście Solvency II | |
| | Katarzyna Budny, Stanisław Wanat | Ograniczenia dla Value-at-Risk: nowe wyniki bazujące na potęgowym uogólnieniu nierówności Cantellego | |
| | Anna Majdzińska | Zastosowanie wybranych metod analizy wielowymiarowej do oceny podobieństwa krajów europejskich pod względem struktury wieku populacji | |
| 13:00-14:00 | Lunch break | | |

| | | | |
|--|---|--|---|
| 14:00-15:30 | Parallel sessions: A2 (English), B2 (Polish) | | |
| Session A2 - Chair: dr hab. Joanna Landmesser-Rusek, prof. SGGW | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3ac88bc33d845b41cea45e666420ddd358%40thread.tacv2/1661943899213?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 14:00-15:30 | Dorota Górecka | EU Cohesion Policy implementation in Poland – evaluation of regions using multi-criteria methods | |
| | Yuliia Poliakova, Solomiya Sokurenko | Long-run effects of the short-run stabilization policies in Ukraine, 2002-2021. | |
| | Viktor Shevchuk | Time-varying exchange rate pass-through in Eastern Europe | |
| Session B2 - Chair: dr hab. inż. Marlena Piekut | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a6ab39ce691de480c815bc6386753be5c%40thread.tacv2/1661944158027?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 14:00-15:30 | Jacek Wolak | Popyt na różnorodność diety w polskich gospodarstwach domowych | |
| | Jacek Bednarz, Patrycja Orzeł | Praktyki CSR/ESG a siła fundamentalna przedsiębiorstw produkujących gry komputerowe | |
| | Karolina Lewandowska-Gwarda | Sytuacja kobiet na lokalnych rynkach pracy w Polsce w dobie pandemii | |
| | Maciej Woźniak | Wpływ pomocy publicznej na efektywność MSP | |
| Plenary Session 2 - Chair: dr hab. Hanna Dudek, prof. SGGW | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a280c434e1da444a88d5183b42fc8fe2%40thread.tacv2/1661945389773?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 15:35-17:05 | Marlena Piekut, Kamil Piekut | Porównanie wzorców konsumpcyjnych w gospodarstwach domowych z Europy | |
| | Anna Sączewska-Piotrowska | Zamożność dochodowa gospodarstw domowych: Polska i jej makroregiony | |
| | Tomasz Rokicki, Radosław Jadczak, Adam Kucharski | Zmiany w energochłonności w krajach UE w wyniku pandemii COVID-19 | |
| 17:05-17:15 | Closing of the conference | | |

| 9 września - piątek | | | Adresy Sesji Teams: |
|--|---|---|---|
| 9:15-9:30 | Otwarcie konferencji | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a535c730ac8dd4469ab9bfd3c51a09ddd%40thread.tacv2/1661942579233?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| Sesja plenarna 1 - prowadzący: prof. dr hab. Bolesław Borkowski | | | |
| 9:30-11:00 | Marek Gruszczyński | Badania ekonometryczne w rachunkowości – aktualne nurty | |
| | Ryszard Szupiluk | Identyfikacja ukrytych komponentów w szeregach czasowych metodami nieujemnej faktoryzacji macierzy | |
| | Aleksandra Łuczak, Sławomir Kalinowski | Metody porządkowania liniowego w ocenie subiektywnego ubóstwa gospodarstw domowych – analiza porównawcza | |
| 11:15-13:00 | Sesje równoległe: A1, B1 | | |
| Sesja A1 - prowadzący: prof. dr hab. Marek Gruszczyński | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a55ca74b812c84e3b9228a3ddf2c50a49%40thread.tacv2/1661943224426?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 11:15-13:00 | Paweł Sakowski, Robert Ślepaczuk, Jakub Michańków | Energy, Crypto Assets, Gold, and Soft Commodities as a Safe Haven in Algorithmic Investment Strategies based on Deep Learning and ARIMA-GARCH models for Equity Indices | |
| | Michał Woźniak, Robert Ślepaczuk | LIGHT Benchmark - comprehensive backtesting framework for market risk models comparison | |
| | Marek Kociński | On Trading on the Stock Market in Case of the Liquidity Shortage | |
| | Sedefoğlu Gülşah, Burak Güriş | Testing for cointegration in STAR models: An empirical example from Turkey | |
| Sesja B1 - prowadząca: dr hab. Aleksandra Łuczak | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a7f8b46fbbecb4b968fe698f10559e08e%40thread.tacv2/1661943710383?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 11:15-13:00 | Małgorzata Just, Krzysztof Echaust | Efektywność zabezpieczenia inwestycji na amerykańskim rynku akcji podczas pandemii COVID-19 | |
| | Szczepan Urjasz, Renata Karkowska | Identyfikacja mechanizmu transmisji ryzyka na rynkach akcji oraz w indeksach energii odnawialnej i nieodnawialnej na świecie | |
| | Anna Denkowska, Krystian Szczyński, Stanisław Wanat | Modelowanie zależności w agregacji ryzyka w kontekście Solvency II | |
| | Katarzyna Budny, Stanisław Wanat | Ograniczenia dla Value-at-Risk: nowe wyniki bazujące na potęgowym uogólnieniu nierówności Cantellego | |
| | Anna Majdzińska | Zastosowanie wybranych metod analizy wielowymiarowej do oceny podobieństwa krajów europejskich pod względem struktury wieku populacji | |
| 13:00-14:00 | Przerwa obiadowa | | |

| | | | |
|---|--|--|---|
| 14:00-15:30 | Sesje równoległe: A2, B2 | | |
| Sesja A2 - prowadzący: dr hab. Joanna Landmesser-Rusek, prof. SGGW | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3ac88bc33d845b41cea45e666420ddd358%40thread.tacv2/1661943899213?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 14:00-15:30 | Dorota Górecka | EU Cohesion Policy implementation in Poland – evaluation of regions using multi-criteria methods | |
| | Yuliia Poliakova, Solomiya Sokurenko | Long-run effects of the short-run stabilization policies in Ukraine, 2002-2021. | |
| | Viktor Shevchuk | Time-varying exchange rate pass-through in Eastern Europe | |
| Sesja B2 - prowadząca: dr hab. inż. Marlena Piekut | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a6ab39ce691de480c815bc6386753be5c%40thread.tacv2/1661944158027?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 14:00-15:30 | Jacek Wolak | Popyt na różnorodność diety w polskich gospodarstwach domowych | |
| | Jacek Bednarz, Patrycja Orzeł | Praktyki CSR/ESG a siła fundamentalna przedsiębiorstw produkujących gry komputerowe | |
| | Karolina Lewandowska-Gwarda | Sytuacja kobiet na lokalnych rynkach pracy w Polsce w dobie pandemii | |
| | Maciej Woźniak | Wpływ pomocy publicznej na efektywność MSP | |
| Sesja plenarna 2 - prowadzący: dr hab. Hanna Dudek, prof. SGGW | | | https://teams.microsoft.com/l/meetup-join/19%3a280c434e1da444a88d5183b42fc8fe2%40thread.tacv2/1661945389773?context=%7b%22Tid%22%3a%2270f92b42-1dd3-41a9-ae0e-01cbe47cbc79%22%2c%22Oid%22%3a%225112241d-99d4-400c-a63f-93756ef067f1%22%7d |
| 15:35-17:05 | Marlena Piekut, Kamil Piekut | Porównanie wzorców konsumpcyjnych w gospodarstwach domowych z Europy | |
| | Anna Sączewska-Piotrowska | Zamożność dochodowa gospodarstw domowych: Polska i jej makroregiony | |
| | Tomasz Rokicki, Radosław Jadczyk, Adam Kucharski | Zmiany w energochłonności w krajach UE w wyniku pandemii COVID-19 | |
| 17:05-17:15 | Zakończenie konferencji | | |