



WARSAW UNIVERSITY OF LIFE SCIENCES
SGGW

INSTITUTE OF ECONOMICS AND FINANCE
DEPARTMENT OF ECONOMETRICS AND STATISTICS



**22ND INTERNATIONAL CONFERENCE
ON
QUANTITATIVE METHODS IN ECONOMICS 2021**

CONFERENCE PROGRAMME
(ON LINE – MS TEAMS)

Warsaw, 23 June 2021

CONFERENCE CHAIRPERSONS:

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

CONFERENCE ORGANISING COMMITTEE:

- Tomasz Woźniakowski – Chair
- Katarzyna Czech – Vice-Chair
- Monika Krawiec
- Anna Górska
- Marek Kociński
- Łukasz Pietrych
- Dominik Sieradzki
- Dominika Urbańczyk

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

CONFERENCE PROGRAMME

09.10 – 09.30	OPENING OF THE CONFERENCE Chair of Organising Committee Chair of Scientific Committee Head of Department of Econometrics and Statistics Director of Institute of Economics and Finance
09.30 – 11:00	PLENARY SESSION I Session chair: prof. dr hab. Bolesław Borkowski
09.30 – 10.00	Profesor zw. dr hab. Stanisław Kasiewicz <i>SGH w Warszawie i ALTERUM</i> ROLA KULTURY RYZYKA WE WSPÓŁCZESNYM ZARZĄDZANIU
10.00 – 10.30	dr hab. Stanisław Wanat, prof. UEK, dr Anna Denkowska <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie</i> BAZUJĄCA NA DTW OCENA MOCY PREDYKCYJNEJ MODELU COPULA-GARCH-MST SKONSTRUOWANEGO DLA EUROPEJSKICH INSTYTUCJI UBEZPIECZENIOWYCH
10.30 – 11.00	prof. dr hab. Bartosz Witkowski, dr hab. Mariusz Próchniak, prof. SGH, dr hab. Michał Bernardelli, prof. SGH <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> SIMULATION-BASED CONVERGENCE FORESIGHT USING HIDDEN MARKOV MODELS
11.15 – 12.45	PARALLEL SESSIONS: A1, B1, C1 (session A1 in English)
11.15 – 12.30	SESSION A1 (in English) Session chair: dr hab. Michał Bernardelli, prof. SGH
11.15 – 11.30	Lorenzo Escot, Associate Proffesor, Julio E. Sandubete, PhD <i>Universidad Complutense de Madrid</i> dr Łukasz Pietrych <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> MEASURING THE EFFECTS OF COVID-19 PANDEMIC ON THE INSTABILITY OF EUROPEAN FINANCIAL MARKETS
11.30 – 11.45	dr hab. Anna Sączewska-Piotrowska, prof. UE <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach</i> LABOR MARKET STATUS AND SUBJECTIVE QUALITY OF LIFE DURING THE COVID-19 PANDEMIC

11.45 – 12.00	<p>Professor Edward I. Altman <i>New York University (NYU) Stern</i> dr Michał Thlon, dr Rafał Sieradzki <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie</i> TRACKING THE IMPACT OF COVID-19 ON CREDIT RISK. THE CASE OF POLAND</p>
12.00 – 12.15	<p>Juliia Poliakova, PhD, Solomiya Sokurenko <i>Lviv University of Trade and Economics</i> CRISIS DEVELOPMENTS IN UKRAINE</p>
12.15 – 12.30	<p>dr Karolina Siemaszkiewicz <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu</i> SAFE HAVEN INSTRUMENTS FOR CENTRAL EUROPE INVESTORS DURING COVID-19 PANDEMIC</p>
11.15 – 12.30	<p>SESSION B1 Session chair: dr hab. Joanna Landmesser, prof. SGGW</p>
11.15 – 11.30	<p>dr hab. Krzysztof Echaust, prof. UEP <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu</i> dr Małgorzata Just <i>Uniwersytet Przyrodniczy w Poznaniu</i> RYZIKO ZDARZEŃ EKSTREMALNYCH NA RYNKACH KAPITAŁOWYCH - ANALIZA TRZECH KRYZYSÓW</p>
11.30 – 11.45	<p>dr hab. Ryszard Szupiluk, prof. SGH, dr Paweł Rubach <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> SEPAROWALNOŚĆ FINANSOWYCH SZEREGÓW CZASOWYCH</p>
11.45 – 12.00	<p>mgr Szymon Lis <i>Uniwersytet Warszawski</i> PORÓWNANIE DOKŁADNOŚCI PROGNOZOWANIA VAR DLA SUROWCÓW Z WYKORZYSTANIEM RÓŻNYCH METOD ŁĄCZENIA PROGNOZ</p>
12.00 – 12.15	<p>dr Dorota Żebrowska-Suchodolska, dr Andrzej Karpio <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> ANALIZA SYTUACJI NA GIEŁDACH KRAJÓW POSTKOMUNISTYCZNYCH PODCZAS PANDEMII COVID-19</p>
12.15 – 12.30	<p>mgr Sylwia Radomska <i>Uniwersytet Warszawski</i> PROGNOZOWANIE INDEKSU WIG20 ZA POMOCĄ SIECI NEURONOWYCH I METODY WEKTORÓW NOŚNYCH</p>
11.15 – 12.45	<p>SESSION C1 Session chair: dr hab. Iwona Markowicz, prof. US</p>
11.15 – 11.30	<p>dr Karolina Lewandowska-Gwarda, dr Elżbieta Antczak <i>Uniwersytet Łódzki</i> STARZENIE SIĘ MIAST W EUROPIE — PRZESTRZENNO-CZASOWA ANALIZA UWARUNKOWAŃ</p>

11.30 – 11.45	dr Jacek Wolak <i>Akademia Górniczo-Hutnicza w Krakowie</i> ANALIZA POZIOMU ŻYCIA W MIASTACH NA PRAWACH POWIATU W POLSCE
11.45 – 12.00	dr Anna Majdzińska <i>Uniwersytet Łódzki</i> KLASYFIKACJE OBSZARÓW EUROPY Z PUNKTU WIDZENIA STRUKTURY WIEKU LUDNOŚCI
12.00 – 12.15	mgr Karolina Bolesta <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> DEKOMPOZYCJA STRUKTURY OSÓB BEZROBOTNYCH URODZONYCH W LATACH 1940-1965
12.15 – 12.30	mgr Bernard Kokczyński <i>Uniwersytet Łódzki</i> ANALIZA NIETYTUŁACALNOŚCI KREDYTOBIORCÓW W PRZEKROJU 30 LAT GOSPODARKI RYNKOWEJ
12.30 – 12.45	dr hab. Mariusz Hamulczuk, mgr Marta Skrzypczyk <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> COVID-19 A CENY ROLNO-ŻYWNOŚCIOWE W KRAJACH UNII EUROPEJSKIEJ.
12.45 – 14.00	PARALLEL SESSIONS: A2, B2, C2 (session A2 in English)
12.45 – 14.00	SESSION A2 (in English) Session chair: dr hab. Ciżkowicz Piotr prof. SGH
12.45 – 13.00	mgr Filip Premik <i>University of Minnesota</i> LARGE SCALE CHILD BENEFIT PROGRAM AND FEMALE LABOR SUPPLY
13.00 – 13.15	lic. Maria Kubara <i>Uniwersytet Warszawski</i> SPATIAL ORGANISATION OF THE INNOVATIVE BUSINESS IN THE URBAN AREA – NEW FRAMEWORK
13.15 – 13.30	dr hab. Helena Gaspars-Wieloch, prof. UEP <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu</i> POSSIBLE NEW APPLICATIONS OF THE INTERACTIVE PROGRAMMING BASED ON ASPIRATION LEVELS
13.30 – 13.45	Akvilė Karaliūtė, PhD <i>Vytautas Magnus University</i> CLUSTER ANALYSIS OF EU-28 COUNTRIES IN TERMS OF INNOVATION
13.45 – 14.00	dr Marcin Dec <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> MARKET-SPECIFIC PARSIMONIOUS GOVERNMENT BONDS YIELD CURVE MODELLING IN LESS LIQUID MARKETS

12.45 – 14.00	SESSION B2 Session chair: dr hab. Anna Sączewska-Piotrowska, prof. UE
12.45 – 13.00	dr hab. inż. Tomasz Rokicki, prof. SGGW <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> ZUŻYCIE ENERGII W ROLNICTWIE W KRAJACH UE
13.00 – 13.15	dr inż. Marlena Piekut <i>Politechnika Warszawska</i> WIELOWYMIAROWE PODEJŚCIE DO BADANIA DEPRYWACJI ENERGETYCZNEJ W GOSPODARSTWACH DOMOWYCH
13.15 – 13.30	dr Marek Kociński <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> O OPTYMALIZACJI HANDLU NA RYNKU ZBOŻOWYM
13.30 – 13.45	dr Aleksandra Matuszewska-Janica, dr Dorota Żebrowska-Suchodolska <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> dr Agnieszka Mazur-Dudzińska SYTUACJA GOSPODARSTW DOMOWYCH NA RYNKU ENERGII W PAŃSTWACH UNII EUROPEJSKIEJ: KONSUMPCJA, CENY I ENERGIA ODNAWIALNA
13.45 – 14.00	dr hab. Dariusz Kayzer, prof. UPP, dr hab. Ryszard Staniszewski, prof. UPP, dr Dorota Czerwińska-Kayzer, dr Joanna Florek <i>Uniwersytet Przyrodniczy w Poznaniu</i> PORÓWNANIE GRUP PRZEDSIĘBIORSTW PRZEMYSŁU SPOŻYWCZEGO POD WZGLĘDEM PŁYNNOŚCI FINANSOWEJ I RENTOWNOŚCI
12.45 – 14.00	SESSION C2 Session chair: dr hab. Beata Bieszk-Stolorz, prof. US
12.45 – 13.00	dr hab. Joanna Kisielińska, prof. SGGW <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> METODA TOPSIS W WERSJI PRZEDZIAŁOWEJ
13.00 – 13.15	dr inż. Aneta Mikuła, dr Monika Utzig, dr inż. Małgorzata Raczkowska <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> ZASTOSOWANIE METODY TOPSIS DO OCENY PROŚRODOWISKOWYCH ZACHOWAŃ GOSPODARSTW DOMOWYCH W KRAJACH UNII EUROPEJSKIEJ
13.15 – 13.30	dr hab. Ewa Frątczak, prof. SGH, mgr Adrianna Wołowicz, mgr inż. Piotr Rozenbajgier <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> WZBOGACENIE PROCESU SEGMENTACJI Z WYKORZYSTANIEM MODELI REKURENCYJNYCH ANALIZY PRZEŻYCIA.
13.30 – 13.45	dr hab. Iwona Markowicz, prof. US, dr Paweł Baran <i>Uniwersytet Szczeciński</i> ASYMETRIA DANYCH LUSTRZANYCH W HANDLU ZAGRANICZNYM – METODY WYZNACZANIA WEDŁUG GRUP TOWAROWYCH

13.45 – 14.00	<p>dr hab. inż. Tadeusz Kwater, prof. PWSTE <i>Państwowa Wyższa Szkoła Techniczno-Ekonomiczna w Jarosławiu</i> dr Marcin Halicki <i>Uniwersytet Rzeszowski</i> BADANIA SYMULACYJNE ŁAŃCUCHA DOSTAW DLA DUŻYCH KATASTROF</p>
14.00 – 15.00	Lunch break
15.00 – 16.30	PARALLEL SESSIONS: A3, B3, C3 (session A3 in English)
15.00 – 16.15	<p>SESSION A3 (in English) Session chair: dr hab. Krzysztof Echaust, prof. UEP</p>
15.00 – 15.15	<p>dr hab. Izabela Pruchnicka-Grabias, prof. SGH <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> HEDGE FUND STRATEGIES AND THEIR PERFORMANCE</p>
15.15 – 15.30	<p>Halyna Velykoivanenko, Professor, Volodymyr Skitsko, Associate Professor, Tetiana Kmytiuk, Associate Professor <i>Kyiv National Economic University named after Vadym Hetman</i> INVESTMENT RISK ASSESSMENT OF DIGITAL ART</p>
15.30 – 15.45	<p>dr inż. Agnieszka Wałachowska <i>Politechnika Gdańska</i> COMPARISON OF THE RENEWABLE ENERGY SOURCES IN CENTRAL AND EASTERN EUROPE COUNTRIES</p>
15.45 – 16.00	<p>dr hab. Piotr Cizkowicz, prof. SGH, dr Wiktor Wojciechowski, dr Jarosław Bełdowski, dr Andrzej Rzońca <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> FISCAL DEVALUATION, PRODUCT MARKET REGULATIONS AND EU ECONOMIC ACTIVITY – INDUSTRY LEVEL APPROACH</p>
16.00 – 16.15	<p>dr Marcin Chlebus, lic. Michał Woźniak <i>Uniwersytet Warszawski</i> HCR-GARCH - NOVEL STATISTICAL LEARNING MODELS FOR VALUE AT RISK ESTIMATION</p>
15.00 – 16.30	<p>SESSION B3 Session chair: dr hab. Barbara Kowalczyk, prof. SGH</p>
15.00 – 15.15	<p>dr Maciej Beręsewicz, Mateusz Marszałkowski <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu</i> INTEGRACJA PRÓB LOSOWYCH I NIELOSOWYCH NA PRZYKŁADZIE BADANIA POPYT NA PRACĘ</p>
15.15 – 15.30	<p>dr Radosław Murkowski <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu</i> NADMIERNA UMIERALNOŚĆ W EUROPIE I NA ŚWIECIE PODCZAS EPIDEMII COVID-19 W 2020 ROKU</p>

15.30 – 15.45	dr hab. Beata Bieszk-Stolorz, prof. US, dr Krzysztof Dmytrów <i>Uniwersytet Szczeciński</i> WYKORZYSTANIE METODY DYNAMIC TIME WARPING DO OCENY ZMIAN SYTUACJI NA RYNKACH PRACY POSTKOMUNISTYCZNYCH CZŁONKÓW UNII EUROPEJSKIEJ
15.45 – 16.00	dr Agata Surówka <i>Politechnika Rzeszowska</i> ANALIZA PRZESTRZENNA REGIONALNYCH RYNKÓW PRACY NA OBSZARACH CIĄŻENIA PORTÓW LOTNICZYCH W POLSCE
16.00 – 16.15	mgr Anna Andrychowska, mgr Paweł Lipiński <i>Uniwersytet Szczeciński</i> PRACA ZDALNA W CZASIE PANDEMII COVID-19 - ANALIZA TRWANIA
16.15 – 16.30	dr Romana Głowicka-Wołoszyn, dr Andrzej Wołoszyn <i>Uniwersytet Przyrodniczy w Poznaniu</i> PROBLEM MATERIALNEJ I SPOŁECZNEJ DEPRYWACJI DZIECI W POLSCE
15.00 – 16.30	SESSION C3 Session chair: dr hab. Sławomir Kalinowski, prof. IRWiR PAN
15.00 – 15.15	dr Sebastian Zając, dr Karol Przanowski <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> KLASYCZNY MODEL SCORINGOWY A MODELE AI/ML
15.15 – 15.30	dr Ryszard Kowalski, dr Agnieszka Wałęga, dr Grzegorz Wałęga <i>Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie</i> KTO JEST FAKTYCZNIE NADMIERNIE ZADŁUŻONY? O ROZBIEŻNOŚCIACH POMIĘDZY SUBIEKTYWNYM I OBIEKTYWNYM OBCIĄŻENIEM DŁUGIEM
15.30 – 15.45	dr Ewelina Nawrocka <i>Uniwersytet Gdański</i> ZNACZENIE DOBORU METODY OKREŚLANIA DYNAMIKI CEN TRANSAKCYJNYCH W PROCESIE WYCENY NIERUCHOMOŚCI
15.45 – 16.00	dr Dorota Górecka, mgr Patrycja Gulak-Lipka <i>Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu</i> ZASTOSOWANIE METODY SIPRES DO OCENY OFERT NEGOCJACYJNYCH W NEGOCJACJACH KONTRAKTU KOSZYKARSKIEGO
16.00 – 16.15	dr hab. Lech Gruszecki, prof. KUL, dr Dorota Jegorow <i>Katolicki Uniwersytet Lubelski Jana Pawła II</i> PODEJMOWANIE I ZAKOŃCZENIE DZIAŁALNOŚCI GOSPODARCZEJ A PŁEĆ PRZEDSIĘBIORCÓW
16.15 – 16.30	dr hab. Sławomir Kalinowski, prof. IRWiR PAN <i>Instytut Rozwoju Wsi i Rolnictwa PAN</i> dr hab. Aleksandra Łuczak, prof. UPP <i>Uniwersytet Przyrodniczy w Poznaniu</i> WIELOWYMIAROWA ANALIZA POZIOMU UBÓSTWA SUBIEKTYWNEGO GOSPODARSTW DOMOWYCH

16.30 – 18.00	PLENARY SESSION II Session chair: prof. dr hab. Wojciech Zieliński
16.30 – 17.00	Professor Yochanan Shachmurove <i>The City College and the Graduate Center of the City University of New York</i> CLEAN-TECH VENTURE CAPITAL INVESTMENT IN THE UNITED STATES, 1995-2020
17.00 – 17.30	prof. dr hab. Bolesław Borkowski, dr hab. Wiesław Szczesny prof. SGGW, dr inż. Marek Karwański <i>Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie</i> METHODOLOGICAL ASPECTS OF BUILDING FORECASTS BASED ON DATA WITH DIFFERENT INTERVALS
17.30 – 18.00	dr hab. Barbara Kowalczyk, prof. SGH <i>Szkoła Główna Handlowa w Warszawie</i> SELECTED MODERN INDIRECT QUESTIONING METHODS
18.00 – 18.10	Closing ceremony