

Łódź, 29.10.2025 r.

Uzasadnienie uchwały Komisji habilitacyjnej z dnia 29 października 2025 roku powołanej w postępowaniu w sprawie nadania stopnia doktora habilitowanego w dziedzinie nauk społecznych w dyscyplinie ekonomia i finanse dr Marcie Małeckiej

Komisja habilitacyjna w składzie:

1. prof. dr hab. Mirosław Szreder – Uniwersytet Gdański – przewodniczący Komisji
2. dr hab. Katarzyna Bień-Barkowska – Szkoła Główna Handlowa – recenzent
3. prof. dr hab. Paweł Miłobędzki – Uniwersytet Gdański – recenzent
4. prof. dr hab. Sławomir Śmiech – Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie - recenzent
5. prof. dr hab. Grażyna Trzpiot – Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach - recenzent
6. prof. dr hab. Jerzy Gajdka – Uniwersytet Łódzki – członek Komisji
7. dr hab. Jerzy Korzeniewski – Uniwersytet Łódzki – sekretarz Komisji.

powołana dnia 16.06.2025 roku przez Komisję Uniwersytetu Łódzkiego do spraw stopni naukowych w dyscyplinie ekonomia i finanse, w celu przeprowadzenia postępowania habilitacyjnego Pani dr Marty Małeckiej w dziedzinie nauk społecznych w dyscyplinie ekonomia i finanse, wyraziła **pozytywną** opinię w sprawie nadania dr Marcie Małeckiej stopnia naukowego doktora habilitowanego w dziedzinie nauk społecznych w dyscyplinie ekonomia i finanse.

Uzasadnienie:

Komisja, po analizie dorobku, wysłuchaniu kolokwium habilitacyjnego i dyskusji stwierdza, iż osiągnięcia naukowe dr Marty Małeckiej po uzyskaniu stopnia doktora stanowią znaczny wkład w rozwój dyscypliny ekonomia i finanse. W szczególności, zdaniem członków Komisji, należy podkreślić osiągnięcie naukowe i znaczący wkład w badania dotyczące rozwoju metod ilościowych stosowanych w analizie ryzyka finansowego, ujęte w cyklu 12 powiązanych tematycznie artykułów naukowych wskazanych przez Habilitantkę (pt. „**Wnioskowanie statystyczne o miarach ryzyka VaR i ES z uwzględnieniem warunków wysokiej zmienności.**”). Do szczególnych

osiągnięć Habilitantki należy zaliczyć: a) dokonanie krytycznej, kompleksowej oceny znanych z literatury modeli zmienności i ryzyka rynkowego oraz wskazanie trzech klas testów o największym potencjale; b) zaproponowanie i scharakteryzowanie nowego modelu zmienności BM-R-GARCH i wykazanie jego zalet w prognozowaniu zmienności; c) zaproponowanie modyfikacji metody momentów ważonych prawdopodobieństwami (PWMM) do estymacji ogonów rozkładów; d) zaproponowanie nowego testu dla miary Expected Shortfall (ES), odpornego na heteroskedastyczność.

Dr Marta Małecka wykazuje się ponadto znaczącą aktywnością naukową w więcej niż jednej uczelni. W szczególności posiada doświadczenie we współpracy międzynarodowej z Prague University of Economics and Business (Czechy) oraz University of Stavanger (Norwegia). W krajowych i międzynarodowych zespołach badawczych zrealizowała dwa granty badawcze finansowane ze źródeł zewnętrznych.

Podpis:

..... Miroslaw Szreder

Prof. dr hab. Miroslaw Szreder – Uniwersytet Gdański, przewodniczący komisji habilitacyjnej

Protokółat sekretarz

Jerzy Kolczewski