PODPIS ZAUFANY
MARTA
MAŁECKA
26.01.2025 13:04:45 [GMT+1]
Dokument podpisany elektronicznie
podpisem zaufanym

Wykaz osiągnięć naukowych

Załącznik nr 4 do wniosku z dnia 26. 01. 2025 r.
o przeprowadzenie postępowania w sprawie nadania stopnia doktora habilitowanego
w dziedzinie nauk społecznych, w dyscyplinie ekonomia i finanse

Marta Małecka
Katedra Metod Statystycznych
Uniwersytet Łódzki

Łódź, 26.01.2025

I. WYKAZ OSIĄGNIĘĆ NAUKOWYCH ALBO ARTYSTYCZNYCH, O KTÓRYCH MOWA W ART. 219 UST. 1. PKT 2 USTAWY

1. Monografia naukowa, zgodnie z art. 219 ust. 1. pkt 2a ustawy

2. Cykl powiązanych tematycznie artykułów naukowych, zgodnie z art. 219 ust. 1. pkt 2b ustawy

„Wnioskowanie statystyczne o miarach ryzyka VaR i ES z uwzględnieniem warunków wysokiej zmienności"

Publikacje po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych

C1 Fiszeder, P., Małecka, M., Molnár, P. (2024). Robust estimation of the range-based GARCH model: Forecasting volatility, value at risk and expected shortfall of cryptocurrencies. ***Economic Modelling***, doi: 10.1016/j.econmod.2024.106887 **(JCR IF 4,2, SCOPUS CITE SCORE 8, 100 pkt. MNiSW)**

Moim wkładem* było teoretyczne opracowanie połączenia modelu zakresu R-GARCH z metodą estymacji odpornej na *outliery*. Wymagało to dostosowania estymatora odpornego do zmodyfikowanego równania wariancji w modelu R-GARCH, ze względu na fakt, że w zmodyfikowanym równaniu zmianie ulegają rozkłady prawdopodobieństwa. Moim wkładem było również przeprowadzenie badań symulacyjnych i empirycznych. Dalszym moim wkładem była propozycja zastosowania nowego modelu do szacowania ryzyka w oparciu o miary VaR i ES. Na etapie badania związanym z szacowaniem ryzyka i oceną tych oszacowań mój udział wiązał się zarówno z opracowaniem koncepcji jak i samym przeprowadzeniem badań. Objął on zastosowanie prognoz wariancji pochodzących z nowego modelu zmienności do parametrycznej i nieparametrycznej estymacji VaR i ES oraz ocenę otrzymanych oszacowań. W szczególności, przeprowadzona została ocena prognoz ryzyka z wykorzystaniem autorskich testów, zarówno VaR jak i ES. Efektem mojego udziału w tym badaniu było zatem połączenie dwóch filarów analizy ryzyka rynkowego, tj. estymacji i testowania w oparciu o autorskie metody.

C2 Małecka, M. (2024). New runs-based approach to testing value at risk forecasts. ***Journal of Forecasting*****, 1–21,** doi: 10.1002/for.3115 **(JCR IF 3,4, SCOPUS CITE SCORE 5,4, 70 pkt. MNiSW)**

C3 Małecka, M., Pietrzyk, R. (2024). A Spectral Approach to Evaluating VaR Forecasts: Stock Market Evidence from the Subprime Mortgage Crisis, through COVID-19, to the Russo-Ukrainian War. ***Quality & Quantity*** **58, 4533–4567**, doi: 10.1007/s11135-024-01866-1 **(JCR IF 1,072, SCOPUS CITE SCORE 4,6, 100 pkt. MEiN)**

Mój wkład* związany był z częścią metodyczną badania, czyli, przede wszystkim, z opracowaniem koncepcji zastosowania teorii spektralnej do konstruowania testów VaR. Konstrukcja takich testów opiera się na porównywaniu empirycznej i teoretycznej funkcji gęstości spektralnej, co wiąże się z dalszym moim wkładem, którym było zaproponowanie statystyk testowych służących potrzebom takich porównań a następnie przedstawienie

teoretycznego uzasadnienia zamiany wcześniej stosowanych statystyk na inne. Moim wkładem było również opracowanie projektu badania symulacyjnego służącego ocenie własności.

C4 Fiszeder, P., Małecka, M. (2022). Forecasting volatility during the outbreak of Russian invasion of Ukraine: application to commodities, stock indices, currencies, and cryptocurrencies. ***Equilibrium. Quarterly Journal of Economics and Economic Policy*****, 17(4), 939–967 (JCR IF 5,7, SCOPUS CITE SCORE 4,9, 100 pkt. MEiN)**

Mój wkład* w części teoretycznej badania związany był głównie z opracowaniem metody estymacji modeli zmienności stosowanych w badaniu. Metody te zastały przeze mnie zaimplementowane w pakiecie R, w szczególności opracowany został kod do estymacji modeli GARCH z wykorzystaniem metod odpornych oraz do estymacji modeli R-GARCH. Następnie przygotowane zostały algorytmy do obliczeń. W części empirycznej mój udział związany był z określeniem zbioru danych oraz zakresu czasowego badania i przeprowadzeniem estymacji modeli. Mój wkład polegał również na doborze metod oceny jakości otrzymanych prognoz, przeprowadzeniu procedur testowych oraz współpracy przy ocenie i interpretacji wyników.

C5 Małecka, M. (2022). Estimation risk taking into consideration the effect of forecasting scheme: robust inference about VaR. ***Wiadomości Statystyczne. The Polish Statistician*****, 67(10), 1–27 (70 pkt. MEiN)**

C6 Małecka, M. (2022). Asymptotic properties of duration-based VaR backtests. ***Statistics & Risk Modeling*****, 39(3-4), 49-73 (JCR IF 1,5, SCOPUS CITE SCORE 1,1, 70 pkt. MEiN)**

C7 Małecka, M. (2021). Industry Standard and Econometric Standard: The Search for Powerful Approach to Evaluate VaR Models. ***Argumenta Oeconomica*** **1(46), 5–30 (JCR IF 0,516, SCOPUS CITE SCORE 0,7, 70 pkt. MEiN)**

C8 Małecka, M. (2021). Testing for Serial Correlation in VaR Failures through Exponential Autoregressive Conditional Duration Model. ***Statistics in Transition new series*****, 22(1), 145–162 (SCOPUS CITE SCORE 0,7, 70 pkt. MEiN)**

C9 Małecka, M. (2020). Extremal Risk Management: expected shortfall value verification using the Bootstrap Method. ***Journal of Computational Finance*****, 23(4), 35-39 (JCR IF 1,025, SCOPUS CITE SCORE 1,8, 70 pkt. MNiSW)**

Publikacje przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych

---

C10 Małecka, M. (2014). GARCH Class Models Performance in Context of High Market Volatility. Acta Universitatis Lodziensis. ***Folia Oeconomica*****, 302(3), 253-266 (14 pkt. MNiSW** – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

C11 Małecka, M., Pekasiewicz, D. (2013). A Modification of the Probability Weighted Method of Moments and Its Application to Estimate the Financial Return Distribution Tail. ***Statistics in Transition new series*****, 14(3), 495-506 (15 pkt. MNiSW** – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Moim wkładem* była koncepcja zastąpienia metody największej wiarygodności zmodyfikowaną metodą momentów ważonych prawdopodobieństwami (PWMM, *probability weighted method of moments*) przy szacowaniu uogólnionego rozkładu Patero oraz wykorzystanie tej koncepcji do

szacowania zmienności na rynku finansowym. Mój udział obejmował teoretyczne połączenie zmodyfikowanej metody PWMM z modelem GARCH wywodzącym się z teorii wartości ekstremalnej, wykorzystującym uogólniony rozkład Pareto. Powstała w ten sposób propozycja teoretyczna została przeze mnie następnie oprogramowana. Moim dalszym wkładem było zaprojektowanie i przeprowadzenie badania symulacyjnego mającego na celu ocenę i porównanie metod oraz dobór optymalnych parametrów nowej metody. W kolejnym etapie, mój udział polegał na przeprowadzeniu badania empirycznego z zastosowaniem nowej propozycji.

C12 Małecka, M. (2011). Prognozowanie zmienności indeksów giełdowych przy wykorzystaniu modelu klasy GARCH. ***Ekonomista*, 6, 843-860 (JCR IF 0,141, 15 pkt. MNiSW** – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Wskaźnki IF oraz SCOPUS CITE SCORE podane są na rok, w którym ukazała się dana publikacja, bądź ostatni dostępny. Ta sama zasada obowiązuje przy punktacji MEiN lub MNiSW – podane są punkty wg wykazu z roku wydania artykułu, bądź wg ostatniego dostępnego wykazu z lat poprzednich.

* Mój wkład merytoryczny i procentowy w powstawanie poszczególnych publikacji jest potwierdzony w oświadczeniach będących załącznikiem nr 6 do wniosku o przeprowadzenie postępowania w sprawie nadania stopnia doktora habilitowanego.

3. Wykaz zrealizowanych oryginalnych osiągnięć projektowych, konstrukcyjnych, technologicznych lub artystycznych, zgodnie z art. 219 ust. 1. pkt 2c ustawy

II. WYKAZ AKTYWNOŚCI NAUKOWEJ ALBO ARTYSTYCZNEJ

1. Wykaz opublikowanych monografii naukowych (niewymienionych w punkcie 1)

Publikacje po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych

M1 Małecka, M. (2016). *Weryfikacja hipotez w ocenie ryzyka rynkowego*. Wydawnictwo Uniwersytetu Łódzkiego (25 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Punktacja MEiN lub MNiSW podana jest zgodnie z zasadami obowiązującymi w ewaluacji jednostek naukowych za odpowiednie lata.

2. Wykaz opublikowanych rozdziałów w monografiach naukowych (niewymienionych w punkcie 1)

Publikacje po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych

R1 Małecka, M. (2020). Resampling vs. Parameter Correction: Ways of Dealing with Parameter Uncertainty in Testing VaR, w: 14th *Professor Aleksander Zeliaś International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena. Conference Proceedings* (red. Papież, M., Śmiech, S.). Wydawnictwo Małopolskiej Szkoły Administracji Publicznej Uniwersytetu Ekonomicznego w Krakowie, Krakow, 97-106 (20 pkt. MNiSW)

R2 Małecka, M. (2020). Geometric Distribution as Means of Increasing Power in Backtesting VaR, w: *Contemporary Trends and Challenges in Finance. Proceedings from the 5th Wroclaw International Conference in Finance* (red. Jajuga, K., Locarek-Junge, H., Orlowski, L., Staehr, K.). Springer, Cham, 159-167 (SCOPUS, 20 pkt. MNiSW)

R3 Małecka, M. (2018). Exponential Autoregressive Conditional Duration Approach to Testing VaR, w: ICoMS 2018: *Proceedings of the 2018 International Conference on Mathematics and Statistics*, ACM, New York, 6-10 (Web Of Science, SCOPUS, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

R4 Małecka, M. (2018). Characterizing Market Behavior through Risk Forecasts: a Powerful VaR Backtesting, w: *ITISE 2018 International Conference on Time Series and Forecasting Proceedings of Papers* (red. Valenzuela, O., Rojas, F., Pomares, H., Rojas, I.). Godel Impresiones Digitales S.L., Granada, 99-110 (5 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

R5 Małecka, M. (2017). Testing VaR Under Basel III with Application to No-Failure Setting, w: *Springer Proceedings in Business and Economics. Proceedings from the 2nd Wroclaw International Conference in Finance* (red. Jajuga, K., Orlowski, L., Staehr, K.). Springer, Cham, 195-202 (Web Of Science, SCOPUS, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Publikacje przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych

R6 Małecka, M. (2014). Ocena efektywności prognoz VaR w kontekście wybranych okresów historii notowań WIG20, w: *Problemy współczesnego rynku ubezpieczeń* (red. Lisowski, J., Manikowski, P.). Wyd. Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu, 87-100 (5 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

R7 Szymańska, A., Małecka, M. (2013). Zastosowanie metody trapezów w ocenie efektywności taryfikacyjnej systemów bonus-malus ubezpieczeń komunikacyjnych OC, w: *Rola informatyki w naukach ekonomicznych i społecznych. Innowacje i implikacje interdyscyplinarne* (red. Zieliński Z.). Wyd. Wyższej Szkoły Handlowej,

Kielce, 243-252 (5 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

R8 Małecka, M. (2012). Wykorzystanie nowych funkcji programu Mathematica 8 w ocenie ryzyka rynkowego, w: *Rola informatyki w naukach ekonomicznych i społecznych. Innowacje i implikacje interdyscyplinarne* (red. Zieliński Z.). Wyd. Wyższej Szkoły Handlowej, Kielce, 192-203 (5 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

R9 Małecka, M., Wdowiński, P. (2010). Asymmetry in Volatility: A Comparison of Developed and Transition Stock Markets, w: *Financial Markets: Principles of Modelling, Forecasting and Decision-Making* 9(1), 155-172 (7 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Punktacja MEiN lub MNiSW podana jest zgodnie z zasadami obowiązującymi w ewaluacji jednostek naukowych za odpowiednie lata.

3. Wykaz członkostwa w redakcjach naukowych monografii

4. Wykaz opublikowanych artykułów w czasopismach naukowych (niewymienionych w punkcie 1)

Publikacje po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych

A1 Małecka, M. (2016). Evaluation of Parametric ES Tests, w: *Proceedings of the 34nd International Conference Mathematical Methods in Economics* 2016 (red.Kocourek, A., Vavrousek, M.). Technical University of Liberec, Liberec, 523-527 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A2 Małecka, M. (2016). Spectral VaR Test Statistical Properties, w: *Proceedings of the 10th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena*, Zakopane 2016 (red. Papież, M., Śmiech, S.). Foundation of the Cracow University of Economics, Kraków, 102-109 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A3 Małecka, M. (2015). Comparative Analysis of Sigma-Based, Quantile-Based and Time Series VaR Estimators. *Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica*, 311(1), 57-68 (14 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Publikacje przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych

A4 Małecka, M. (2014). Multivariate approach to testing VaR models, w: *Proceedings of the 32nd International Conference Mathematical Methods in Economics* 2014 (red. Talasova, J., Stoklasa, J., Talalek, T.). Palacky University, Olomouc, 596-601 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A5 Małecka, M. (2014). Parametric hypothesis testing in evaluation of expected shortfall models, w: *Proceedings of the 8th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena*, Zakopane 2014 (red. Papież, M., Śmiech, S.). Foundation of the Cracow University of Economics, Kraków, 115-124 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A6 Małecka, M. (2014). Duration-Based Approach to VaR Independence Backtesting. *Statistics in Transition*, 15(4), 627-637 (15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A7 Małecka, M. (2013). Statistical properties of duration-based VaR backtesting procedures in finite sample setting, w: *Proceedings of the 7th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena*, Zakopane 2013 (red. Papież, M., Śmiech, S.), Foundation of the Cracow University of Economics, 181-189 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A8 Małecka, M. (2013). Metody oceny jakości prognoz ryzyka rynkowego – analiza porównawcza. *Prace Naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu*, 323, 192-201 (10 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A9 Małecka, M. (2013). Experimental design in evaluating VaR forecasts. *Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica*, 286, 277-290 (14 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A10 Małecka, M. (2013). GARCH process application in risk valuation for WIG20 index. *Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica*, 285, 209-220 (14 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A11 Małecka, M., Pekasiewicz, D. (2013). Application of probability weighted method of moments to estimation of financial return distribution tail, w: *Proceedings of the 31st International Conference Mathematical Methods in Economics* 2013 (red. Vojáčková, H.). College of Polytechnics Jihlava, Jihlava, 569-574 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A12 Szymańska, A., Małecka, M. (2013). Influence of transition matrix in bonus-malus systems on tariff effectiveness in car instance, w: *Proceedings of the 31st International*

Conference Mathematical Methods in Economics 2013 (red. Vojáčková H.). College of Polytechnics Jihlava, Jihlava, 903-909 (Web Of Science, 15 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

A13 Małecka, M. (2007). Zmienność implikowana w opcjach piątym czynnikiem ryzyka rynkowego. *Acta Universitatis Lodziensis. Folia Oeconomica*, 209, s. 135-145 (4 pkt. MNiSW – publikacja sprzed reformy wprowadzającej nowe zasady punktacji)

Punktacja MEiN lub MNiSW podana jest wg wykazu z roku wydania artykułu, bądź wg ostatniego dostępnego wykazu z lat poprzednich.

5. Wykaz osiągnięć projektowych, konstrukcyjnych, technologicznych

6. Wykaz publicznych realizacji dzieł artystycznych

7. Wykaz wystąpień na krajowych lub międzynarodowych konferencjach naukowych lub artystycznych, z wyszczególnieniem przedstawionych wykładów na zaproszenie i wykładów plenarnych

Konferencje za granicą

	Konferencje za granicą po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych
2024	**18th Conference of the International Federation of Classification Societies (IFCS), San José, Costa Rica**, 15-19 lipca, 2024, referaty: Piotr Fiszeder, Marta Małecka, *Robust estimation of the range-based GARCH model: Forecasting volatility, value at risk and expected shortfall of cryptocurrencies* Marta Małecka, Radosław Pietrzyk, *A Spectral Approach to Evaluating VaR Forecasts: Stock Market Evidence from the Subprime Mortgage Crisis, through COVID-19, to the Russo-Ukrainian War*
2022	**International Conference on Mathematics and Statistics ICoMS 2022, Paryż, Francja**, 17-19 czerwca 2022, referat: Marta Małecka, Radosław Pietrzyk, *Improved ML Approach to Testing Unconditional VaR Coverage. Evidence from Cryptocurrencies Market*
2018	**International Conference on Time Series and Forecasting ITISE 2018, Grenada, Hiszpania**, 19-21 września 2018, referat: Marta Małecka, *Characterizing Market Behavior through Risk Forecasts: a Powerful VaR Backtesting*

2018	**International Conference on Mathematics and Statistics ICOMS 2018, Porto, Portugalia**, 15-17 lipca 2018, referat: Marta Małecka, *Exponential Autoregressive Conditional Duration Approach to Testing VaR* – **wykład plenarny**
2016	**34th International Conference on Mathematical Methods in Economics, Liberec, Czechy**, 6-9 września 2016, referat: Marta Malecka, *Evaluation of Parametric ES Tests*
2016	**10th Annual International Conference on Mathematics & Statistics, Ateny, Grecja**, 27-30 czerwca 2016, referat: Marta Malecka, *Nonparametric Methods of Statistical Inference in ES Testing* - **wykład plenarny**
	Konferencje za granicą przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych
2014	**32nd International Conference on Mathematical Methods in Economics, Olomouc, Czechy**, 10-12 września 2014, referat: Marta Malecka, *Multivariate approach to testing VaR models*
2014	**XXXII International Seminar on Stability Problems for Stochastic Models, Trondheim, Norwegia**, 16-21 czerwca 2014, referaty: Marta Małecka, *Verification statistical hypothesis about ES value in finite sample setting* - **wykład plenarny,** Marta Małecka, Michał Szymczak, *Optimum estimators for the modified Weibull distribution of censored data*
2013	**31st International conference on Mathematical Methods in Economics, Jihlava, Czechy**, 11-13 września 2013, referaty: Marta Malecka, Dorota Pekasiewicz, *Application of probability weighted method of moments to estimation of financial return distribution tail*, Anna Szymanska, Marta Malecka, *Influence of transition matrix in bonus-malus systems on tariff effectiveness in car insurance*

Konferencje w kraju

	Konferencje w kraju po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych
2022	**VIII Wrocław Conference in Finance WROFIN, Wrocław**, 16-18 listopada 2022, referat: Piotr Fiszeder, Marta Małecka, *Forecasting volatility during the outbreak of Russian invasion of Ukraine: Application to commodities, stock indices, currencies, and cryptocurrencies*

2022 **III Kongres Statystyki Polskiej, Kraków**, 26-28 kwietnia 2022, referat: Marta Małecka, Radosław Pietrzyk, *Zastosowanie metody bootstrapowej do odpornej estymacji parametrów GARCH. Przykład z rynku kryptowalut*

2021 **39th International Conference Multivariate Statistical Analysis MSA 2021, Łódź**, 8-10 listopada 2021, referat: Marta Małecka, *Robust Bootstrap Procedure for Testing VaR*

2021 **14th Professor Aleksander Zeliaś International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena, Kraków**, 10-13 maja 2021, referat: Marta Małecka, *Resampling vs. Parameter Correction: Ways of Dealing with Parameter Uncertainty in Testing VaR*

2019 **38th International Conference Multivariate Statistical Analysis MSA 2019, Łódź**, 4-6 listopada 2019, referat: Marta Małecka, *Asymptotic Properties of Duration-Based VaR Backtests*

2019 **V Wrocław Conference in Finance WROFIN, Wrocław**, 24-25 września 2019, referat: Marta Malecka, *Geometric Distribution as Means of Increasing Power in Backtesting VaR*

2019 **13th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena, Zakopane**, 13-16 maja 2019, referat: Marta Malecka, *Nonparametric, series-based method for backtesting independence of VaR failures*

2018 **37th International Conference Multivariate Statistical Analysis MSA 2018, Łódź**, 5-7 listopada 2018, referat: Marta Małecka, *Likelihood Ratio Distribution under Non-Standard Conditions: Application to Testing VaR*

2016 **II Wrocław Conference in Finance WROFIN, Wrocław**, 27-28 września 2016, referat: Marta Malecka, *Testing VaR under Basel III with application to no-failure setting*

2016 **XXV Konferencja Sekcji Klasyfikacji i Analizy Danych PTS, Bełchatów**, 19-21 września 2016, referat: Marta Malecka, *Ocena własności parametrycznych metod weryfikacji wartości ES*

2016 **Potencjał wiedzy, szansa na efektywne zarządzanie procesami, Łódź**, 2-3 czerwca 2016, organizatorzy: 2KConsulting, Katedra Metod Statystycznych UŁ, referat: Marta Malecka, *Zastosowanie modeli Value-at-Risk i Expected Shortfal do zarządzania ryzykiem cen surowców*

2016 **10th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena, Zakopane**, 10-13 maja 2016, referat: Marta Malecka, *Spectral VaR test statistical properties*

	Konferencje za granicą przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych
2014	**XVII Konferencja Naukowa Inwestycje finansowe i ubezpieczenia INWEST 2014 Wrocław**, 17-19 września 2014, referat: Marta Małecka, *Spectral density tests in VaR failure independence analysis*
2014	**8th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena, Zakopane**, 6-9 maja 2014, referat: Marta Małecka, *Parametric hypothesis testing in evaluation of expected shortfall models*
2013	**XVI Ogólnopolska Konferencja Naukowa Inwestycje finansowe i ubezpieczenia – tendencje światowe a rynek Polski, Karpacz**, 23-25 września 2013, referat: Marta Małecka, *Konstrukcja eksperymentów przy badaniu mocy testów niezależności VaR*
2013	**7th Professor Aleksander Zelias International Conference on Modelling and Forecasting of Socio-Economic Phenomena, Zakopane**, 7-10 maja 2013, referat: Marta Małecka, *Statistical properties of duration-based VaR backtesting procedures in finite sample setting*
2012	**XV Ogólnopolska Konferencja Naukowa Inwestycje finansowe i ubezpieczenia – tendencje światowe a rynek Polski, Karpacz**, 1-3 października 2012, referat: Marta Małecka, *Metody oceny jakości prognoz ryzyka rynkowego – analiza porównawcza*
2012	**VI Międzynarodowa Konferencja Naukowa Ubezpieczenia wobec wyzwań XXI wieku, Rydzyna**, 21-23 maja 2012, referat: Marta Małecka, *Ocena efektywności prognoz VaR w kontekście wybranych okresów historii notowań WIG20*
2012	**Kongres Statystyki Polskiej, Poznań, 18-20 kwietnia 2012**, referat: Marta Małecka, *Ocena wariancji estymatorów wartości narażonej na ryzyko (VaR)*

8. Wykaz udziału w komitetach organizacyjnych i naukowych konferencji krajowych lub międzynarodowych, z podaniem pełnionej funkcji

Czterokrotna funkcja sekretarza konferencji:

Multivariate Statistical Analysis MSA 2013, 2014, 2021, 2022 – konferencja organizowana wspólnie przez Katedrę Metod Statystycznych UŁ, Instytut Statystyki i Demografii UŁ, Polską Akademię Nauk oraz Polskie Towarzystwo Statystyczne, Oddział w Łodzi

9. Wykaz uczestnictwa w pracach zespołów badawczych realizujących projekty finansowane w drodze konkursów krajowych lub zagranicznych, z podziałem na projekty zrealizowane i będące w toku realizacji, oraz z uwzględnieniem informacji o pełnionej funkcji w ramach prac zespołów

	Projekty będące w toku realizacji
2022-2025	**„Metody odporne dla modeli zakresu cen – Analiza ryzyka i współbieżności na rynku kryptowalut”**, projekt badawczy NCN nr 2021/43/B/HS4/00353 – funkcja głównego wykonawcy
	Projekty zrealizowane po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych
2014-2018	**„Weryfikacja hipotez w ocenie ryzyka rynkowego”,** projekt badawczy NCN nr 2013/11/N/HS4/03354 – funkcja kierownika projektu
	Projekty zrealizowane przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych
	–

10. Wykaz członkostwa w międzynarodowych lub krajowych organizacjach i towarzystwach naukowych wraz z informacją o pełnionych funkcjach

Polskie Towarzystwo Statystyczne (PTS) – funkcja członka zwyczajnego

Sekcja Klasyfikacji i Analizy Danych (SKAD) Polskiego Towarzystwa Statystycznego (PTS) – funkcja członka zwyczajnego

11. Wykaz staży w instytucjach naukowych lub artystycznych, w tym zagranicznych, z podaniem miejsca, terminu, czasu trwania stażu i jego charakteru

Staż naukowy w Uniwersytecie Ekonomicznym we Wrocławiu

Opiekun stażu: prof. Krzysztof Jajuga

Termin: 01.06.2023 – 31.08.2023

Czas trwania: 3 miesiące

Charakter stażu:

Staż obejmował następujące aktywności:

- spotkania i konsultacje z pracownikami Katedry Inwestycji Finansowych i Zarządzania Ryzykiem Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu dotyczące stosowania metod statystycznych w prognozowaniu i testowaniu prognoz zmienności i ryzyka na rynkach finansowych,
- ustalenie i zakresu prac związanych z opracowywaniem nowego podejścia do weryfikacji prognoz ryzyka wg miary VaR,
- tworzenie skryptów w języku R,
- projektowanie i prowadzenie badań symulacyjnych,
- selekcja i analiza danych,
- opracowanie i przeprowadzenie badania empirycznego,
- podsumowanie badań i przygotowaniu ostatecznej wersji artykułu, nad którym praca rozpoczęła się jeszcze w ramach realizacji grantu wewnętrznego Uniwersytetu Łódzkiego.

W ramach stażu została złożona ostateczna wersja artykułu naukowego podsumowującego badania nad spektralnymi testami VaR do czasopisma International Journal of Methodology *Quality and Quantity*. Efektem tego była następująca publikacja

Małecka, M., & Pietrzyk R. (2024). A spectral approach to evaluating *VaR* forecasts: stock market evidence from the subprime mortgage crisis, through COVID-19, to the Russo–Ukrainian war. *Quality & Quantity* 58, 4533–4567.

12. Wykaz członkostwa w komitetach redakcyjnych i radach naukowych czasopism wraz z informacją o pełnionych funkcjach (np. redaktora naczelnego, przewodniczącego rady naukowej, itp.

13. Wykaz recenzowanych prac naukowych lub artystycznych, w szczególności publikowanych w czasopismach międzynarodowych

Recenzje w czasopismach międzynarodowych:
Quality & Quantity (wydawca Springer Nature) – 3 recenzje
International Review of Financial Analysis (wydawca Elsevier) – 1 recenzja
Mathematics and Computers in Simulation (wydawca Elsevier) – 3 recenzje
Statistics in Transition (wydawca Główny Urząd Statystyczny) – 9 recenzji

14. Wykaz uczestnictwa w programach europejskich lub innych programach międzynarodowych

Stypendium Unii Europejskiej Szwecja, University of Orebro, 2005–2006, program Erasmus

15. Wykaz udziału w zespołach badawczych, realizujących projekty inne niż określone w pkt. II.9.

	Projekty zrealizowane po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych
2021-2023	**„Od kryzysu kredytów hipotecznych do COVID-19: Jak efektywny jest globalny system zarządzania ryzykiem w oparciu o miarę VaR”**, projekt badawczy IDUB, realizowany we współpracy z Uniwersytetem Ekonomicznym we Wrocławiu – funkcja kierownika projektu
2020	**„Wpływ ryzyka estymacji na testowanie modeli Value-at-Risk”**, projekt w ramach konkursu na badania młodych naukowców UŁ – funkcja kierownika projektu
2019	**„Nowa, nieparametryczna metoda testowania modeli VaR, oparta na rozkładzie serii”**, projekt w ramach konkursu na badania młodych naukowców UŁ – funkcja kierownika projektu
2015	**„Weryfikacja hipotez o oczekiwanym niedoborze (ES)”**, projekt w ramach konkursu na badania młodych naukowców UŁ – funkcja kierownika projektu
	Projekty zrealizowane przed uzyskaniem stopnia doktora nauk ekonomicznych
2014	**„Uogólnione estymatory największej wiarygodności parametrów zmodyfikowanego rozkładu Weibulla”**, projekt w ramach konkursu na badania młodych naukowców UŁ – funkcja kierownika projektu
2013	**„Moc i rozmiar testów niezależności w ocenie modeli ryzyka”**, projekt w ramach konkursu na badania młodych naukowców UŁ – funkcja kierownika projektu
2012	**„Zastosowanie procesów stochastycznych do oceny ryzyka na rynku finansowym”**, projekt w ramach konkursu na badania młodych naukowców UŁ – funkcja kierownika projektu

16. Wykaz uczestnictwa w zespołach oceniających wnioski o finansowanie badań, wnioski o przyznanie nagród naukowych, wnioski w innych konkursach mających charakter naukowy lub dydaktyczny

Uczestnictwo w zespole recenzentów wniosków grantowych IDUB od 2022 roku

IDUB – granty, w ramach których Uniwersytet Łódzki finansuje pomysły badawcze swoich naukowców i doktorantów z subwencji dla uczelni, które w 2019 roku przystąpiły do konkursu Inicjatywa Doskonałości – Uczelnia Badawcza, uczestnictwo w zespole od 2022 roku

Uczestnictwo w zespole recenzentów wniosków grantowych EkSoc Grant od 2021 roku

EkSoc Grant – granty przyznawane pracownikom naukowym przez dziekana wydziału Ekonomiczno-Socjologicznego UŁ, uczestnictwo w zespole od 2021 roku

III. WSPÓŁPRACA Z OTOCZENIEM SPOŁECZNYM I GOSPODARCZYM

1. Wykaz dorobku technologicznego

2. Współpraca z sektorem gospodarczym

3. Wykaz uzyskanych praw własności przemysłowej, w tym uzyskanych patentów krajowych lub międzynarodowych

4. Wykaz wdrożonych technologii

5. Wykaz wykonanych ekspertyz lub innych opracowań wykonanych na zamówienie instytucji publicznych lub przedsiębiorców

6. Wykaz udziału w zespołach eksperckich lub konkursowych

7. Wykaz projektów artystycznych realizowanych ze środowiskami pozaartystycznymi

IV. DANE NAUKOMETRYCZNE

1. Impact Factor (w dziedzinach i dyscyplinach, w których parametr ten jest powszechnie używany jako wskaźnik naukometryczny)

Liczba artykułów w czasopismach z wyznaczonym wskaźnikiem JCR IF według Web of Science: 8

Sumaryczny JCR IF autora według Web of Science: 17,554

2. Liczba cytowań publikacji wnioskodawcy, z oddzielnym uwzględnieniem autocytowań

Liczba cytowań według Google Scholar: 93

Liczba cytowań bez autocytowań według Google Scholar: 69

Liczba cytowań według Research Gate: 93

Liczba cytowań bez autocytowań według Research Gate: 69

Liczba cytowań według Web of Science: 39

Liczba cytowań bez autocytowań według Web of Science: 28

Liczba cytowań według SCOPUS: 28

Liczba cytowań bez autocytowań według SCOPUS: 25

3. Indeks Hirscha

Indeks Hirscha wg Google Scholar oraz Research Gate (bez autocytowań): 4

Indeks Hirscha wg baz Web of Science i SCOPUS: 2

……..……..…….

(podpis wnioskodawcy)