

Wykaz osiągnięć naukowych albo artystycznych, stanowiących znaczny wkład w rozwój określonej dyscypliny

Informacje zawarte w poszczególnych punktach tego dokumentu powinny uwzględniać podział na okres przed uzyskaniem stopnia doktora oraz po jego uzyskaniu.

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

1. Monografie naukowe, zgodnie z art. 219 ust. 1. pkt 2a ustawy; lub
 2. Cykl powiązanych tematycznie artykułów naukowych, zgodnie z art. 219 ust. 1. pkt 2b ustawy; lub
- [1] Fiszeder Piotr, Fałdziński Marcin, Molnár Peter: Range-based DCC models for covariance and value-at-risk forecasting, *Journal of Empirical Finance*, vol. 54, 2019, s. 58-76, DOI:10.1016/j.jempfin.2019.08.004, MEiN: **100 pkt.**, IF: **1,566**
 - [2] Fiszeder Piotr, Fałdziński Marcin: Improving forecasts with the co-range dynamic conditional correlation model, *Journal of Economic Dynamics & Control*, vol. 108, 2019, s. 1-16, DOI:10.1016/j.jedc.2019.103736, MEiN: **140 pkt.**, IF: **1,204**
 - [3] Fałdziński Marcin, Fiszeder Piotr, Orzeszko Witold: Forecasting volatility of energy commodities: comparison of GARCH models with support vector regression, *Energies*, vol. 14, nr 1, 2021, s. 1-18, DOI:10.3390/en14010006, MEiN: **140 pkt.**, IF: **3,252**
 - [4] Fiszeder Piotr, Fałdziński Marcin, Molnár Peter: Attention to oil prices and its impact on the oil, gold and stock markets and their covariance, *Energy Economics*, vol. 120, 2023, s. 1-10, DOI:10.1016/j.eneco.2023.106643, MEiN: **200 pkt.**, IF: **13,6**
 - [5] Fiszeder Piotr, Fałdziński Marcin, Molnár Peter: Modeling and forecasting dynamic conditional correlations with opening, high, low, and closing prices, *Journal of Empirical Finance*, vol. 70, 2023, s. 308-321, DOI:10.1016/j.jempfin.2022.12.007, MEiN: **100 pkt.**, IF: **2,1**
 - [6] Fałdziński Marcin, Fiszeder Piotr, Molnár Peter: Improving volatility forecasts: Evidence from range-based models, *The North American Journal of Economics and Finance*, vol. 69, 102019, 2024, s. 1-28, <https://doi.org/10.1016/j.najef.2023.102019>, MEiN: **70 pkt.**, IF: **3,8**
 - [7] Fałdziński Marcin: Peaks over Threshold Approach with a time-varying scale parameter and range-based volatility estimator for Value-at-Risk and Expected Shortfall estimation, *Przegląd Statystyczny. Statistical Review*, vol. 71, 2024, 1, 23-77, <https://doi.org/10.59139/ps.2024.01.2>, MEiN: **40 pkt.**

Mój udział w wymienionych publikacjach wynosi: publikacje [1], [3],[4] oraz [5] po 33,(3)%, publikacje [2] i [6] po 50% oraz publikacja [7] jest to 100%. We wszystkich tych artykułach byłem współodpowiedzialny/odpowiedzialny za koncepcję

badawczą, przygotowanie danych, oprogramowanie niezbędnych algorytmów i ich przetestowanie, wykonanie obliczeń oraz przygotowanie publikacji. Szczegółowa informacja o zakresie prac w publikacjach współautorskich zawarta jest w Załączniku 2 oraz potwierdzona załączonymi oświadczeniami.

3. Zrealizowane oryginalne osiągnięcia projektowe, konstrukcyjne, technologiczne lub artystyczne, zgodnie z art. 219 ust. 1. pkt 2c ustawy;
4. Inne, niż wymienione w pkt. I.1-3, osiągnięcia naukowe lub artystyczne.

Publikacje komplementarne do wchodzących w skład cyklu

- [8] Fatdziński Marcin, Osińska Magdalena: The use of range-based volatility estimators in testing for Granger causality in risk on international capital markets, *Journal of Risk Model Validation*, vol. 14, nr 3, 2020, s. 1-27, DOI:10.21314/JRMV.2020.224, MEiN: **40 pkt.**, IF: **0,357**
- [9] Fatdziński Marcin, Pietrzak Michał Bernard: The multivariate DCC-GARCH model with interdependence among markets in conditional variances' equations, *Przegląd Statystyczny*, vol. 62, nr 4, 2015, s. 397-413, MEiN: **14 pkt.**

Publikacje znajdujące się poza tematyką omówioną jako główne osiągnięcie naukowe

- [10] Orzeszko Witold, Fatdziński Marcin, Siemińska Ewa: Real Estate Valuation Algorithm Using Nonparametric Regression Methods. *Ekonomia i Prawo. Economics and Law*, vol. 23, no. 4, s. 655 - 673. DOI 10.12775/EiP.2024.33. MEiN: **70 pkt.**, IF: **0,3**
- [11] Osińska Magdalena, Gatecki Maciej, Boehlke Jerzy, Fatdziński Marcin, Khan Atif, Shachmurov Yochanan, *Bulleting of Geography. Socio-Economic Series*, Extended Threshold Error Correction Model of economic growth in Israel, Wydawnictwo Naukowe UMK, nr 57, 2022, s. 45-63, MEiN: **100 pkt.**, IF: **1.1.**
- [12] Fatdziński Marcin, Osińska Magdalena, Zalewski Wojciech: Extreme value theory in application to delivery delays, *Entropy*, MDPIAG, vol. 23, nr 7, 2021, s. 1-15, DOI:10.3390/e23070788, MEiN: **100 pkt.**, IF: **2,738**
- [13] Boehlke Jerzy, Fatdziński Marcin, Gatecki Maciej, Osińska Magdalena: Searching for factors of accelerated economic growth : the case of Ireland and Turkey, *European Research Studies Journal*, University of Piraeus, International Strategic Management Association, vol. 23, nr 1, 2020, s. 292-304, DOI:10.35808/ersj/1550, MEiN: **100 pkt.**
- [14] Boehlke Jerzy, Fatdziński Marcin, Gatecki Maciej, Osińska Magdalena: Econometric analysis of economic miracles in selected economies using TECM approach, W: *Economic miracles in the European economies* / ed. Magdalena Osińska / Osińska Magdalena (red.), 2019, Springer, Springer International Publishing, ISBN 978-3-030-05605-6, s. 175-230, DOI:10.1007/978-3-030-05606-3_9, MEiN: **20 pkt.**
- [15] Fatdziński Marcin: Testing for structural breaks in macroeconomic processes of growth, W: *Economic miracles in the European economies* / ed. Magdalena Osińska / Osińska Magdalena (red.), 2019, Springer, Springer International Publishing, ISBN 978-3-030-05605-6, s. 125-150, DOI:10.1007/978-3-030-05606-3_7, MEiN: **20 pkt.**
- [16] Boehlke Jerzy, Fatdziński Marcin, Gatecki Maciej, Osińska Magdalena: Economic growth in Ireland in 1980-2014 : a threshold cointegration approach, *Argumenta*

Oeconomica, nr 2, 2018, s. 157-188, DOI:10.15611/aoe.2018.2.07, MEiN: **15 pkt.**, IF: **0,347**

- [17] Meluzín Tomáš, Fałdziński Marcin, Pietrzak Michał, Balcerzak Adam, Zinecker Marek: The use of backtesting in assessment of the value-at-risk on Unites States, Great Britain and German capital markets, W: European Financial Systems 2018 : proceedings of the 15th International Scientific Conference, June 25-26, 2018 Brno, Czech Republic / [ed. by Josef Nešleha, Filip Hampl, Miroslav Svoboda] / Nešleha Josef, Hampl Filip, Svoboda Miroslav (red.), 2018, Masaryk University. Faculty of Law, ISBN 978-80-210-8980-8, s. 395-401, MEiN: **15 pkt.**
- [18] Zinecker Marek, Fałdziński Marcin, Meluzín Tomáš, Pietrzak Michał, Balcerzak Adam: Application of tests Juc, Jcc and Jind for checking the correctness of the value-at-risk : an example of United States and German capital markets, W: The 12th International Days of Statistics and Economics, September 6-8, 2018, Prague, Czech Republic : conference proceedings / Löster Tomáš, Pavelka Tomáš (red.), 2018, Melandrium, ISBN 978-80-87990-14-8, s. 2054-2063, MEiN: **15 pkt.**
- [19] Zinecker Marek, Meluzín Tomáš, Fałdziński Marcin, Balcerzak Adam, Pietrzak Michał: The use of backtesting binominal tests in assessment of the value-at-risk on German and Polish capital markets, W: Proceedings of the International Scientific Conference Quantitative Methods in Economics : Multiple Criteria Decision Making XIX, 23rd May - 25th May 2018, Trenčianske Teplice, Slovakia / [ed.: Marian Reiff, Pavel Gežík] / Reiff Marian, Gežík Pavel (red.), 2018, Letra Edu, ISBN 978-80-89962-07-5, s. 390-397, MEiN: **15 pkt.**
- [20] Zinecker Marek, Pietrzak Michał, Fałdziński Marcin, Balcerzak Adam, Meluzín Tomáš: The use of tests LRuc, LRind, LRcc on example of estimation of the Value-at-Risk for WIG, DAX and DJIA indices, W: Mathematical Methods in Economics MME 2018 : 36th International Conference, Jindřichův Hradec, September 12-14, 2018 : conference proceedings / eds.: Lucie Váchová, Václav Kratochvíl / Váchová Lucie, Kratochvíl Václav (red.), 2018, MatfyzPress Publishing House of the Faculty of Mathematics and Physics Charles University, ISBN 978-80-7378-371-6, s. 636-641, MEiN: **15 pkt.**
- [21] Boehlke Jerzy, Fałdziński Marcin, Gatecki Maciej, Osińska Magdalena: Dynamics of economic growth in Ireland in 1980-2014, Naučno-Tehničeskie Vedomosti SPbGPU. Ekonomičeskie Nauki, vol. 10, nr 2, 2017, s. 7-20, DOI:10.18721/JE.10201, MEiN: **1 pkt.**
- [22] Pietrzak Michał Bernard, Fałdziński Marcin, Balcerzak Adam P., Meluzín Tomáš, Zinecker Marek: Short-term shocks and long-term relationships of interdependencies among Central European capital markets, Economics & Sociology, Centre of Sociological Research - Ukraine, vol. 10, nr 1, 2017, s. 61-77, DOI:10.14254/2071-789X.2017/10-1/5, MEiN: **15 pkt.**
- [23] Fałdziński Marcin: Backtesting value-at-risk for multiple risk levels: a lexicographic ordering approach, W: Mathematical methods in economics 2017: proceedings of the 35th International Conference, 13th-15th September 2017, Hradec Králové, Czech Republic / [ed. Pavel Pražák] / Pražák Pavel (red.), 2017, University of Hradec Králové, ISBN 978-80-7435-678-0, s. 155-160, MEiN: **15 pkt.**
- [24] Balcerzak Adam P., Fałdziński Marcin, Pietrzak Michał Bernard, Meluzín Tomáš, Zinecker Marek: Analiza powiązań pomiędzy rynkami kapitałowymi wybranych krajów Grupy Wyszehradzkiej, Studia i Prace Wydziału Nauk Ekonomicznych i Zarządzania Uniwersytetu Szczecińskiego, nr 45, 2016, s. 11-28, DOI:10.18276/sip.2016.45/1-01, MEiN: **9 pkt.**

- [25] Fatdziński Marcin, Osińska Magdalena: Volatility estimators in econometric analysis of risk transfer on capital markets, *Dynamic Econometric Models*, vol. 16, 2016, s. 21-35, DOI:10.12775/DEM.2016.002, MEiN: **13 pkt.**
- [26] Boehlke Jerzy, Fatdziński Marcin, Gatecki Maciej, Osińska Magdalena: Economic miracles in light of institutional economics, W: *Proceedings of the 6th EACO International Scientific Conference*, December 8-9, 2016, Krakow, Poland / ed.: Zuzana Machová / Machová Zuzana (red.), 2016, European Association Comenius - EACO & VŠEO, ISBN 978-80-905405-2-1, s. 17-30, MEiN: **5 pkt.**
- [27] Fatdziński Marcin, Balcerzak Adam, Meluzín Tomáš, Pietrzak Michał, Zinecker Marek: Cointegration of interdependencies among capital markets of chosen Visegrad countries and Germany, W: *Mathematical methods in economics 2016: proceedings of the 34th International Conference*, 6th-9th September 2016, Liberec, Czech Republic / eds, Aleš Kocourek, Miroslav Vavroušek, edited by Aleš Kocourek and Miroslav Vavroušek, s. 189-194. Liberec: Technical University of Liberec, MEiN: **5 pkt.**
- [28] Balcerzak, Adam, Marcin Fatdziński, Tomáš Meluzín, Michał Pietrzak, and Marek Zinecker: Interdependence among Capital Markets of Germany, Poland and Baltic States : Application of DCC-GARCH Model, W: *8th International Scientific Conference Managing and Modelling of Financial Risks*, VŠB-TU of Ostrava, Faculty of Economics, Department of Finance, Ostrava, 5th-6th September 2016: *Proceedings. Part 1*, Ostrava: Technical University of Ostrava, s. 28-36., MEiN: **5 pkt.**
- [29] Zinecker Marek, Balcerzak Adam, Fatdziński Marcin, Meluzín Tomáš, Pietrzak Michał: Application of DCC-GARCH model for analysis of interrelations among capital markets of Poland, Czech Republic and Germany, W: *Proceedings of the International Scientific Conference Quantitative Methods in Economics (Multiple Criteria Decision Making XVIII)*, 25th May - 27th May 2016, Vrátňa, Slovakia / ed.: Marian Reiff, Pavel Gežík / Reiff Marian, Gežík Pavel (red.), 2016, Letra Interactive, ISBN 978-80-972328-0-1, s. 416-420.
- [30] Fatdziński Marcin: Analiza transferu ryzyka ekstremalnego między wybranymi rynkami finansowymi z zastosowaniem przyczynowości w ryzyku w sensie Grangera, *Przegląd Statystyczny*, vol. 61, nr 4, 2014, s. 433-448, MEiN: **8 pkt.**
- [31] Osińska Magdalena, Fatdziński Marcin, *Econometric Analysis of Risk Transfer between Central Asian Currencies*, W: *Materiały Międzynarodowej Naučno-Praktycznej Internet-Konferencji "Problemy Sovremennoj Ékonomiki i Obrazovaniâ"*, 6-7 Fevralâ 2014 G. T. 1 = *Materials of the International Scientific and Practical Internet Conference "Problems of the Modern Economy and Education"*, February 6-7, 2014. Vol. 1 / Red. V. A. Korvâkov [et Al.], Almaty: Almatinskâ Akademiâ Ékonomiki i Statistiki, s. 89-95.
- [32] Fatdziński Marcin: Teoria wartości ekstremalnych w ekonometrii finansowej, 2014, Wydawnictwo Naukowe Uniwersytetu Mikołaja Kopernika, ISBN 978-83-231-3184-7, 162 s., MEiN: **20 pkt.**

W przypadku prac dwu- lub wieloautorских zaleca się złożenie oświadczenia przez habilitanta oraz współautorów wskazujące na ich merytoryczny (a NIE procentowy) wkład w powstanie każdej pracy [np. twórca hipotezy badawczej, pomysłodawca badań, wykonanie specyficznych badań (np. przeprowadzenie konkretnych doświadczeń, opracowanie i zebranie ankiet, itp.), wykonanie analizy wyników, przygotowanie manuskryptu artykułu, i inne]. Określenie wkładu danego autora, w tym habilitanta,

powinno być na tyle precyzyjne, aby umożliwić dokładną ocenę jego udziału i roli w powstaniu każdej pracy.

II. WYKAZ AKTYWNOŚCI NAUKOWEJ ALBO ARTYSTYCZNEJ

1. Wykaz członkostwa w redakcjach naukowych monografii.
2. Wykaz wystąpień na krajowych lub międzynarodowych konferencjach naukowych lub artystycznych, z wyszczególnieniem przedstawionych wykładów na zaproszenie i wykładów plenarnych.

Po uzyskaniu stopnia doktora

1. Wygłoszony referat pt. "Improving Volatility Forecasts: Simulation and Empirical Evidence from Range-Based Models", wspólnie z P. Fiszeder, P. Molnár, na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 4 - 6 września 2023 r.
2. Wygłoszony referat pt. "Modeling and Forecasting Dynamic Conditional Correlations with Opening, High, low and closing prices", wspólnie z P. Fiszeder, P. Molnár, na konferencji The 8th Annual Conference of the International Association for Applied Econometrics, zorganizowanej przez The International Association for Applied Econometrics, Londyn, 21 - 24 czerwca 2022 r.
3. Wygłoszony referat pt. "Modeling and forecasting dynamic conditional correlations with high-low range", wspólnie z P. Fiszeder, P. Molnár, na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 6 - 7 września 2021 r.
4. Wygłoszony referat pt. "Improving Volatility Forecasts: Evidence from Range-Based Models", wspólnie z P. Fiszeder, P. Molnár, na konferencji 19th Annual International Conference on Finance, zorganizowanej przez Athens Institute for Education and Research, Ateny, 5 - 8 lipca 2021 r.
5. Wygłoszony referat pt. "Improving volatility forecasts: evidence from range-based models", wspólnie z P. Fiszeder, P. Molnár, na konferencji ERFIN Econometric Research in Finance Workshop, zorganizowanej przez Szkoła Główna Handlowa, Warszawa, 18 - 18 września 2020 r.
6. Wygłoszony referat pt. "Combining the dynamic conditional correlation and Range-GARCH models to improve covariance forecasts", wspólnie z P. Fiszeder, na konferencji International Conference on Applied Econometrics, zorganizowanej przez The World Academy of Science, Engineering and Technology, Rzym, 20 - 25 marca 2020 r.
7. Wygłoszony referat pt. "Testing for Structural Breaks in Macroeconomic Processes of Growth - A Case of Ireland, Spain, Turkey and Netherlands", na konferencji 26th EBES Conference - Prague, zorganizowanej przez The Eurasia Business and Economics Society (EBES), Praga, 24 - 26 października 2018 r.
8. Wygłoszony referat pt. "The use of tests LRuc, LRind, LRcc on example of estimation of the Value-at-Risk for WIG, DAX and DJIA indices", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji Mathematical Methods in Economics MME 2018: 36th International Conference,

zorganizowanej przez Mathematical Methods in Economics MME 2018 : 36th International Conference, Jindřichův Hradec, 12 - 14 września 2018 r.

9. Wygłoszony referat pt. "Application of tests Juc, Jcc and Jind for checking the correctness of the value-at-risk : an example of United States and German capital markets", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji The 12th International Days of Statistics and Economics, zorganizowanej przez University of Economics, Praga, 6 - 8 września 2018 r.
10. Wygłoszony referat pt. "The use of backtesting in assessment of the value-at-risk on Unites States, Great Britain and German capital markets", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji European Financial Systems 2018 15th International Scientific Conference, zorganizowanej przez The Department of Finance at Masaryk University, Brno, 25 - 26 czerwca 2018 r.
11. Wygłoszony referat pt. "The use of backtesting binominal tests in assessment of the value-at-risk on German and Polish capital markets", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji International Scientific Conference Quantitative Methods in Economics : Multiple Criteria Decision Making XIX, zorganizowanej przez Department of Operations Research and Econometrics Faculty of Economic Informatics University of Economics in Bratislava, Trenčianske Teplice, 23 - 25 maja 2018 r.
12. Wygłoszony referat pt. "Backtesting value-at-risk for multiple risk levels: a lexicographic ordering approach", na konferencji 35th International Conference on Mathematical Methods in Economics, zorganizowanej przez University of Hradec Králové, Faculty of Informatics and Management, Hradec Králové, 13 - 15 lutego 2018 r.
13. Wygłoszony referat pt. "Modeling economic growth in the TECM framework", wspólnie z M. Osińska, M. Gątecki, na konferencji Macromodels International Conference, zorganizowanej przez Uniwersytet Łódzki, Wąsowo, 13 - 16 listopada 2017 r.
14. Wygłoszony referat pt. "Estimation of Value-at-Risk with Application of DCC-GARCH Model with Interdependence in Conditional Variance Equations", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji XXXVI Konferencja Naukowa Wielowymiarowa Analiza Statystyczna (Multivariate Statistical Analysis MSA), zorganizowanej przez Instytut Statystyki i Demografii oraz Katedrę Metod Statystycznych Uniwersytetu Łódzkiego, Spała, 6 - 8 listopada 2017 r.
15. Wygłoszony referat pt. "Performance of Volatility Estimators in Testing for Granger Causality in Risk on International Capital Markets", wspólnie z M. Osińska, na konferencji World Finance Conference 2017, zorganizowanej przez Università Degli Studi di Cagliari, Cagliari, 25 - 28 lipca 2017 r.
16. Wygłoszony referat pt. "Linearity vs. Non-Linearity in a Mechanism of Economic Growth", wspólnie z M. Osińska, M. Gątecki, na konferencji VII Konferencja Naukowa Modelowanie i Prognozowanie Gospodarki Narodowej, zorganizowanej przez Uniwersytet Gdański, Sopot, 29 - 31 maja 2017
17. Wygłoszony referat pt. "Modeling Economic Growth in Ireland and in Spain Using TECM Approach", wspólnie z M. Osińska, J. Boehlke, M. Gątecki, na konferencji Statistics of the XXI Century: New Challenges, New Opportunities, zorganizowanej przez Department of Statistics and Demography Faculty of Economics Taras Shevchenko National University of Kyiv, Kijów, 23 - 26 maja 2017 r.
18. Wygłoszony referat pt. "Economic growth in Ireland - a comparison of GDP and GNP", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji 43rd Macromodels International Conference, zorganizowanej przez Institute of Econometrics and Statistics University of Lodz, Polish Academy of Sciences, Łódź, 14 - 16 listopada 2016 r.

19. Wygłoszony referat pt. "Transfer ryzyka ekstremalnego z zastosowaniem przyczynowości w ryzyku w sensie Grangera – przypadek Polski", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji IX Konferencja Ogólnopolska Rynek Kapitałowy, Skuteczne Inwestowanie, zorganizowanej przez Uniwersytet Szczeciński, Międzyzdroje, 7 - 9 września 2016 r.
20. Wygłoszony referat pt. "Cointegration of Interdependencies Among Capital Markets of Chosen Visegrad Countries and Germany", wspólnie z M. Pietrzak, A. Balcerzak, na konferencji 34th International Conference on Mathematical Methods in Economics, zorganizowanej przez Technical University of Liberec, Liberec, 6 - 9 września 2016 r.
21. Wygłoszony referat pt. "Application of DCC-GARCH model for analysis of interrelations among capital markets of Poland, Czech Republic and Germany", wspólnie z M. Pietrzak, A. Balcerzak, na konferencji International Scientific Conference Quantitative Methods in Economics: Multiple Criteria Decision Making XVIII, zorganizowanej przez University of Economics in Bratislava, Vrátna, 25 - 26 maja 2016 r.
22. Wygłoszony referat pt. "Modeling economic growth in Ireland in 1973-2014 a threshold cointegration approach", wspólnie z M. Osińska, na konferencji 21st International Scientific Conference, Economics and Management, zorganizowanej przez University of Technology, Brno, 18 - 21 maja 2016 r.
23. Wygłoszony referat pt. "Wielowymiarowy model DCC-GARCH z uwzględnieniem współzależności między rynkami w zakresie warunkowej wariancji", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji Seminarium z ekonometrii finansowej, zorganizowanej przez Wydział Matematyki i Informatyki UAM, Poznań, 11 - 11 grudnia 2015 r.
24. Wygłoszony referat pt. "The Multidimensional Value-at-Risk Backtesting", na konferencji Multivariate Statistical Analysis MSA, zorganizowanej przez Uniwersytet Łódzki, Łódź, 16 - 18 listopada 2015 r.
25. Wygłoszony referat pt. "Economic growth in Ireland in 1980-2014 as an example of economic miracle - a threshold cointegration approach", wspólnie z M. Osińska, M. Gatecki, na konferencji VI Konferencja Naukowa z cyklu Ekonomia i Prawo, zorganizowanej przez Katedra Teorii Ekonomii WNEiZ UMK, Toruń, 15 - 16 września 2015 r.
26. Wygłoszony referat pt. "Analiza współzależności w ryzyku z wykorzystaniem różnych miar zmienności – przypadek państw BRIC", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 8 - 10 września 2015 r.
27. Wygłoszony referat pt. "Wykorzystanie przestrzennej macierzy wag w modelach GARCH w celu uwzględnienia wzajemnego oddziaływania rynków kapitałowych", wspólnie z M. Pietrzak, na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 8 - 10 września 2015 r.
28. Wygłoszony referat pt. "Zastosowanie mapy ryzyka w celu uwzględnienia wielkości strat w testowaniu wstecznym", na konferencji XVI Konferencja Metody Ilościowe w Badaniach Ekonomicznych, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki, Wydział Zastosowań Informatyki i Matematyki SGGW, Warszawa, 22 - 23 czerwca 2015 r.

Przed uzyskaniem stopnia doktora

1. Wygłoszony referat pt. "Ekonometryczna analiza tempa wzrostu gospodarki Irlandii w latach 1980-2014 jako przykład cudu gospodarczego", wspólnie z M. Osińska, na konferencji Modelowanie i Prognozowanie Gospodarki Narodowej, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Katedra Statystyki, Wydział Zarządzania UG, Sopot, 6 - 8 maja 2015
2. Wygłoszony referat pt. "Transfer ryzyka ekstremalnego z zastosowaniem przyczynowości w ryzyku w sensie Grangera - przypadek Polski", na konferencji Rynek Kapitałowy VIII Konferencja Skuteczne inwestowanie, zorganizowanej przez Katedra Ubezpieczeń i Rynków Kapitałowych Uniwersytet Szczeciński, Międzyzdroje, 10 - 12 września 2014
3. Wygłoszony referat pt. "Analiza transferu ryzyka ekstremalnego między wybranymi rynkami finansowymi z zastosowaniem przyczynowości w ryzyku w sensie Grangera", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji Metody Ilościowe w Badaniach Ekonomicznych, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki, Wydział Zastosowań Informatyki i Matematyki SGGW, Warszawa, 23 - 24 czerwca 2014
4. Wygłoszony referat pt. "Transmisja ryzyka na polski rynek finansowy", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 3 - 5 września 2013
5. Wygłoszony referat pt. "Links between financial markets and fundamental processes in China", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji Financial Markets Principles of Modelling Forecasting and Decision-Making, zorganizowanej przez Uniwersytet Łódzki, Spółka, 8 - 10 maja 2012
6. Wygłoszony referat pt. "Analiza zależności w ryzyku na rynkach finansowych", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji Ryzyko w działalności podmiotów gospodarczych, zorganizowanej przez Wydział Zarządzania Politechniki Częstochowskiej, Częstochowa, 24 - 25 października 2011
7. Wygłoszony referat pt. "Szacowanie wartości zagrożonej przy użyciu metody Self-Exciting POT", na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 6 - 9 września 2011
8. Wygłoszony referat pt. "Granger causality in variance - implementation of Cheung-Ng and Hong procedures in Gretl", wspólnie z M. Osińska, T. Zdanowicz, na konferencji 2nd gretl Conference, zorganizowanej przez WNEiZ UMK oraz Wyższa Szkoła Bankowa w Toruniu, Toruń, 16 - 17 czerwca 2011
9. Wygłoszony referat pt. "Modelling extreme-value dependence on the financial market in China", na konferencji Contemporary Issues in Economy: After the Crisis?, zorganizowanej przez PTE Oddział w Toruniu oraz WNEiZ UMK, Toruń, 13 - 14 maja 2011
10. Wygłoszony referat pt. "Econometric Analysis of the Risk Transfer on Capital Markets. A Case of China", wspólnie z M. Osińska, T. Zdanowicz, na konferencji 71st International Atlantic Economic Conference, zorganizowanej przez Internacional Atlantic Economic Society, Ateny, 16 - 19 marca 2011
11. Wygłoszony referat pt. "Zastosowanie zmodyfikowanej metody POT z modelami zmienności do oceny ryzyka inwestycyjnego na rynku kapitałowym", na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 8 - 10 września 2009

12. Wygłoszony referat pt. "Usefulness of the Spectral Risk Measures with Extreme Value Theory Approach", na konferencji Financial Markets Principles of Modelling Forecasting and Decision-Making, zorganizowanej przez Uniwersytet Łódzki, Łódź, 7 - 9 maja 2009
13. Wygłoszony referat pt. "Szacowanie prawdopodobnej maksymalnej straty przy zastosowaniu teorii wartości ekstremalnych na przykładzie indeksów giełdowych", na konferencji Współczesne Zjawiska w Gospodarce, zorganizowanej przez PTE Oddział w Toruniu oraz WNEiZ UMK, Toruń, 22 - 24 listopada 2008
14. Wygłoszony referat pt. "Porównanie nieparametrycznych estymatorów indeksu wartości ekstremalnych", na konferencji Warsztaty Doktorskie z Zakresu Ekonometrii i Statystyki, zorganizowanej przez Uniwersytet Łódzki, Spała, 4 - 8 czerwca 2008
15. Wygłoszony referat pt. "Metoda bloków i indeks ekstremalny w teorii wartości ekstremalnych", na konferencji Współczesne Zjawiska w Gospodarce, zorganizowanej przez PTE Oddział w Toruniu oraz WNEiZ UMK, Toruń, 23 - 24 listopada 2007
16. Wygłoszony referat pt. "Modele GARCH i SV z zastosowaniem teorii wartości ekstremalnych", wspólnie z: M. Osińska, na konferencji Ogólnopolskie Seminaria Naukowe Profesora Zygmunta Zielińskiego, Dynamiczne Modele Ekonometryczne, zorganizowanej przez Katedra Ekonometrii i Statystyki UMK, Toruń, 4 - 6 września 2007

3. Wykaz udziału w komitetach organizacyjnych i naukowych konferencji krajowych lub międzynarodowych, z podaniem pełnionej funkcji.
4. 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.

1. Udział w projektach badawczych w ramach konkursu międzynarodowego

- a. 20-16786S pt. „Online attention and financial markets” organizowanego przez Czech Grant Agency, realizowany w latach 2020-2023.

2. Udział w projektach badawczych w ramach konkursu ogólnokrajowego

- a. 2016/21/B/HS4/00662 pt. „Wielowymiarowe model zmienności - wykorzystanie cen minimalnych i maksymalnych” w ramach konkursu OPUS, organizowanego przez Narodowe Centrum Nauki. Realizowany w latach 2017-2022. Wyniki projektu badawczego (publikacje [1], [2], [5] i [6])
- b. 2015/17/B/HS4/01000 pt. „Ekonometryczna analiza czynników przyspieszonego wzrostu w europejskich gospodarkach rynkowych” w ramach konkursu OPUS, organizowanego przez Narodowe Centrum Nauki. Realizowany w latach 2015-2019. Budżet projektu: 201580 zł. Wyniki projektu badawczego (publikacje [13]-[16] oraz [26]).

3. Kierowanie projektem badawczym w ramach konkursu ogólnoucześnieńianego

- a. 2585/2020 pt. “Quantitative risk management with application of high and low prices in case of multivariate models” w ramach konkursu Inicjatywa Doskonałości – Uczelnia Badawcza, organizowanego przez Uniwersytet Mikołaja Kopernika. Realizowany w latach 2020-2021. Budżet projektu: 15000 zł. Wyniki projektu badawczego (publikacja [3])

4. Kierowanie projektem badawczym w ramach konkursu ogólnowydziałowego

- a. 2183-E pt. „Metody testowania wstecznego w analizie ryzyka rynkowego” w ramach wydziałowego grantu dla młodych naukowców. Okres realizacji: 2016 rok. Wyniki projektu badawczego (publikacje [17]-[20] oraz [23]).
 - b. 2587-E pt. „Ekonometryczna analiza powiązań rynków kapitałowych z wykorzystaniem wielowymiarowych modeli zmienności” w ramach wydziałowego grantu dla młodych naukowców. Okres realizacji: 2015 rok. Wyniki projektu badawczego (publikacje [22], [24] oraz [29]).
 - c. 1842-E pt. „Analiza transferu ryzyka ekstremalnego na wybranych rynkach finansowych świata” w ramach wydziałowego grantu dla młodych naukowców. Okres realizacji: 2014 rok. Wyniki projektu badawczego (publikacje [25] oraz [30]).
5. Wykaz członkostwa w międzynarodowych lub krajowych organizacjach i towarzystwach naukowych wraz z informacją o pełnionych funkcjach.
 6. Wykaz staży w instytucjach naukowych lub artystycznych, w tym zagranicznych, z podaniem miejsca, terminu, czasu trwania stażu i jego charakteru.
 7. Wykaz członkostwa w komitetach redakcyjnych i radach naukowych czasopism wraz z informacją o pełnionych funkcjach (np. redaktora naczelnego, przewodniczącego rady naukowej, itp.).
 8. Wykaz recenzowanych prac naukowych lub artystycznych, w szczególności publikowanych w czasopismach międzynarodowych.
Po doktoracie, opracowałem łącznie cztery recenzje artykułów naukowych. Recenzowałem teksty nadane do następujących czasopism naukowych: *Computational Statistics*, *Mathematics*, *Przegląd Statystyczny* oraz *Unia Europejska.pl*
 9. Wykaz uczestnictwa w programach europejskich lub innych programach międzynarodowych.
 10. Wykaz udziału w zespołach badawczych, realizujących projekty inne niż określone w pkt. II.4.
 11. Wykaz uczestnictwa w zespołach oceniających wnioski o finansowanie badań, wnioski o przyznanie nagród naukowych, wnioski w innych konkursach mających charakter naukowy lub dydaktyczny.

III. WSPÓLPRA Z OTOCZENIEM SPOŁECZNYM I GOSPODARCZYM

1. Wykaz dorobku technologicznego.

2. Współpraca z sektorem gospodarczym.

X 2014 – obecnie	adiunkt , Wydział Nauk Ekonomicznych i Zarządzania, UMK w Toruniu
VII 2021 – obecnie	główny developer globalnego modelu ICAAP (Internal Capital Adequacy Assessment Process) dla ryzyka kredytowego typu „wholesale”, CITIBANK Poland PLC
X 2010 – IX 2014	asystent , Wydział Nauk Ekonomicznych i Zarządzania, UMK w Toruniu
X 2019 – IX 2021	wykładowca , Wyższa Szkoła Gospodarki w Bydgoszczy
2021	wykładowca , kurs Quantitative Risk Management, Department of Monetary Theory and Policy na Prague University of Economics and Business
2019, 2018, 2017, 2016	wykonawca prac zleconych , raporty dotyczące walidacji modeli ekonometrycznych oceny ryzyka zmian wartości na nieruchomościach dla Centrum Prawa Bankowego i Informacji Sp. z o.o., tzw. Centrum AMRON
2023, 2021	wykonawca prac zleconych , modele prognostyczne zmiany wartości zabezpieczeń kredytów hipotecznych dla lokali mieszkalnych, budynków jednorodzinnych oraz nieruchomości komercyjnych, Centrum Prawa Bankowego i Informacji Sp. z o.o., tzw. Centrum AMRON
2019	wykonawca prac zleconych , algorytm wyznaczania trendu zmian wartości nieruchomości oraz algorytmu predykcji wartości nieruchomości Centrum Prawa Bankowego i Informacji Sp. z o.o., tzw. Centrum AMRON
XII 2008 – I 2011	specjalista , Urząd Statystyczny w Bydgoszczy
IX 2006 – X 2007	kontroler finansowy , Torfarm S.A. (obecnie Neuca S.A.)

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).
2. Liczba cytowań publikacji wnioskodawcy, z oddzielnym uwzględnieniem autocytowań.
3. Indeks Hirscha.

Jestem autorem lub współautorem 46 publikacji, w tym 32 opublikowanych po uzyskaniu stopnia doktora nauk ekonomicznych (Tabela 1). 11 artykułów naukowych

opublikowałem w czasopismach indeksowanych w bazie *Journal Citation Reports*, większość z pozostałych artykułów naukowych ukazała się w uznanych czasopismach ogólnopolskich i europejskich.

Tabela 1 Zestawienie publikacji po uzyskaniu stopnia doktora

Typ publikacji	Liczba publikacji	Liczba punktów MNiSW*
Artykuły w recenzowanych czasopismach naukowych	19	1275
Monografie ¹ i rozdziały w monografiach	6	80
Materiały konferencyjne	7	70
Razem	32	1425

*Liczba punktów Ministerstwa Nauki i Szkolnictwa Wyższego obowiązująca w roku publikacji. Źródło: opracowanie własne na podstawie systemu Omega

Tabela 2 Zestawienie publikacji w bazach oraz cytowania po uzyskaniu stopnia doktora

Nazwa bazy	Liczba publikacji w bazie	Cytowania	<i>h</i> -index
Web of Science (WoS)	22	194	7
Scopus	14	144	6
Google Scholar	33	308	10
Research Gate	26	221	8

Źródło: opracowanie własne na podstawie Web of Science, Scopus, Google Scholar oraz Research Gate.

Sumaryczny wskaźnik **Impact Factor** (IF), moich publikacji po uzyskaniu stopnia doktora, wynosi **30,364**. Łączna liczba punktów MNiSW, moich publikacji po uzyskaniu stopnia doktora, wynosi **1425**. Tabela 2 prezentuje cytowania oraz *h*-index dla publikacji po uzyskaniu stopnia doktora według czterech baz z publikacjami naukowymi. Indeks *i*-10 wynosi 6 od 2018 roku, natomiast całkowity wynosi 10, na podstawie informacji z Google Scholar.

Według portalu Research Gate, liczba wyświetleń² za lata 2014-2025 wynosi 10311, spośród których 2912 to wyświetlenia lub pobrania pełnych tekstów artykułów.

Informacje zawarte w pkt. IV powinny wskazywać również na bazę danych, na podstawie której zostały podane.

¹ Samodzielna autorska monografia **Błąd! Nie można odnaleźć źródła odwołania.** naukowa ukazała się rok po obronie doktoratu (2014 rok), gdzie w dużym stopniu, opiera się na osiągnięciach przedstawionych w procesie doktorskim.

² Wyświetlenie (ang. Reads) na portalu Research Gate rozumiane jest jako wyświetlenie posumowania publikacji (takie jak tytuł, abstrakt oraz lista autorów), kliknięcia na wykresy w publikacji, wyświetleń lub pobrań pełnego tekstu publikacji.

Przy wyborze tej bazy należy zwracać uwagę na specyfikę dziedziny i dyscypliny naukowej, w której kandydat ubiega się o nadanie stopnia doktora habilitowanego.

Rada Doskonałości Naukowej informuje, że podawanie danych naukometrycznych – w opinii Rady Doskonałości Naukowej – jest wskazane i zalecane, wynika to także ze stosowanej powszechnie praktyki przez samych kandydatów ubiegających się o awans naukowy. Należy jednak podkreślić, że podane we wnioskach o wszczęcie postępowania awansowego dane naukometryczne nie mogą stanowić kryterium oceny dorobku naukowego Kandydata dla podmiotów doktoryzujących, habilitujących oraz samej Rady Doskonałości Naukowej, organów prowadzących postępowania w sprawie nadania stopnia lub tytułu. Zadaniem tych organów jest przede wszystkim ocena ekspercka dorobku naukowego Kandydata ubiegającego się o awans naukowy, zaś decyzja o nadaniu stopnia lub tytułu nie powinna być uzależniona od podania tych danych.

Marcin Faltuziński

(podpis wnioskodawcy)