

## Czasopisma Elsevier

### Cytowanie artykułu:

Modele klasy ARCH zostały zaprezentowane w artykułach Engle (1982), Bollerslev (1986) oraz Nelson (1991)

### Cytowanie książki:

Modele VAR są bardzo szczegółowo opisane w książkach Lütkepohl (2007) oraz Welfe (2000)

### Cytowanie zeszytu naukowego:

O frykcjach finansowych w modelu DSGE możemy przeczytać w opracowaniu Brzoza-Brzezina et al. (2011)

## Literatura

Bollerslev, T., 1986. Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity. *Journal of Econometrics* 31 (3), 307–327.

Brzoza-Brzezina, M., Kolasa, M., Makarski, K., 2011. The anatomy of standard DSGE models with financial frictions. National Bank of Poland Working Papers 80, National Bank of Poland.

Engle, R. F., 1982. Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of united kingdom inflation. *Econometrica* 50, 987–1007.

Lütkepohl, H., 2007. *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*, corr. 2nd print Edition. Springer, Berlin.

Nelson, D. B., 1991. Conditional heteroskedasticity in asset returns: A new approach. *Econometrica* 59 (2), 347–70.

Welfe, A. (Ed.), 2000. *Gospodarka Polski w okresie transformacji*. Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa.

# Journal of Political Economy

## Cytowanie artykułu:

Modele klasy ARCH zostały zaprezentowane w artykułach Engle (1982), Bollerslev (1986) oraz Nelson (1991)

## Cytowanie książki:

Modele VAR są bardzo szczegółowo opisane w książkach Lütkepohl (2007) oraz Welfe (2000)

## Cytowanie zeszytu naukowego:

O frykcjach finansowych w modelu DSGE możemy przeczytać w opracowaniu Brzoza-Brzezina, Kolasa, and Makarski (2011)

## Literatura

Bollerslev, Tim. 1986. "Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity." *Journal of Econometrics* 31 (3):307–327.

Brzoza-Brzezina, Michał, Marcin Kolasa, and Krzysztof Makarski. 2011. "The Anatomy of Standard DSGE Models with Financial Frictions." National Bank of Poland Working Papers 80, National Bank of Poland.

Engle, R. F. 1982. "Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation." *Econometrica* 50:987–1007.

Lütkepohl, Helmut. 2007. *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*. Berlin: Springer, corr. 2nd print ed.

Nelson, Daniel B. 1991. "Conditional Heteroskedasticity in Asset Returns: A New Approach." *Econometrica* 59 (2):347–70.

Welfe, Aleksander, editor. 2000. *Gospodarka Polski w okresie transformacji*. Warszawa: Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne.

# American Economic Review

## Cytowanie artykułu:

Modele klasy ARCH zostały zaprezentowane w artykułach Engle (1982), Bollerslev (1986) oraz Nelson (1991)

## Cytowanie książki:

Modele VAR są bardzo szczegółowo opisane w książkach Lütkepohl (2007) oraz Welfe, ed (2000)

## Cytowanie zeszytu naukowego:

O frykacjach finansowych w modelu DSGE możemy przeczytać w opracowaniu Brzoza-Brzezina et al. (2011)

## Literatura

**Bollerslev, Tim**, “Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity,” *Journal of Econometrics*, 1986, 31 (3), 307–327.

**Brzoza-Brzezina, Michał, Marcin Kolasa, and Krzysztof Makarski**, “The Anatomy of Standard DSGE Models with Financial Frictions,” National Bank of Poland Working Papers 80, National Bank of Poland 2011.

**Engle, R. F.**, “Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation,” *Econometrica*, 1982, 50, 987–1007.

**Lütkepohl, Helmut**, *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*, corr. 2nd print ed., Berlin: Springer, 2007.

**Nelson, Daniel B.**, “Conditional Heteroskedasticity in Asset Returns: A New Approach,” *Econometrica*, 1991, 59 (2), 347–70.

**Welfe, Aleksander, ed.**, *Gospodarka Polski w okresie transformacji*, Warszawa: Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, 2000.

# Journal of Applied Econometrics

## Cytowanie artykułu:

Modele klasy ARCH zostały zaprezentowane w artykułach Engle (1982), Bollerslev (1986) oraz Nelson (1991)

## Cytowanie książki:

Modele VAR są bardzo szczegółowo opisane w książkach Lütkepohl (2007) oraz Welfe (2000)

## Cytowanie zeszytu naukowego:

O frykcjach finansowych w modelu DSGE możemy przeczytać w opracowaniu Brzoza-Brzezina et al. (2011)

## Literatura

Bollerslev T. 1986. Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity. *Journal of Econometrics* **31**: 307–327.

Brzoza-Brzezina M, Kolasa M, Makarski K. 2011. The anatomy of standard DSGE models with financial frictions. National Bank of Poland Working Papers 80, National Bank of Poland.

Engle RF. 1982. Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of united kingdom inflation. *Econometrica* **50**: 987–1007.

Lütkepohl H. 2007. *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*. Berlin: Springer, corr. 2nd print edition. ISBN 9783540401728.

Nelson DB. 1991. Conditional heteroskedasticity in asset returns: A new approach. *Econometrica* **59**: 347–70.

Welfe A (ed.) . 2000. *Gospodarka Polski w okresie transformacji*. Warszawa: Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne.