Autor o Editor
Sergio Ocampo, Norberto Rodríguez

Artículo publicado en: *Revista Colombiana de Estadística*, vol. 35, núm. 3, pp. 477-506, diciembre, 2012.

Este documento cubre la estimación e implementación del modelo VAR-X estructural con restricciones de identificación de corto y largo plazos. Se presenta la estimación tanto por métodos clásicos, como bayesianos. También, se describen aplicaciones del modelo, como impulsos-respuesta ante choques estructurales, análisis de multiplicadores de las variables exógenas, descomposición de varianza del error de pronóstico y descomposición histórica de las variables endógenas. Así mismo, se presenta un método para calcular regiones de alta densidad posterior en el contexto bayesiano. Algunos de los conceptos son ejemplificados con una aplicación a datos de los Estados Unidos.