Pronósticos condicionados para modelos VAR

Borrador número 62 Tenga en cuenta
La serie Borradores de Economía, de la Subgerencia de Estudios Económicos del Banco de la República, contribuye a la difusión y promoción de la investigación realizada por los empleados de la institución. Esta serie se encuentra indexada en Research Papers in Economics (RePEc).

En múltiples ocasiones estos trabajos han sido el resultado de la colaboración con personas de otras instituciones nacionales o internacionales. Los trabajos son de carácter provisional, las opiniones y posibles errores son responsabilidad exclusiva del autor y sus contenidos no comprometen al Banco de la República ni a su Junta Directiva.

Autor o Editor Luis Fernando Melo Autores y/o editores Melo-Velandia, Luis Fernando

En este documento se presenta una metodología para estimar pronósticos con intervalos de confianza para modelos VAR o VEC. incorporando metas o restricciones lineales sobre los valores futuros de las variables. Esta metodología incluye la posibilidad de evaluar la compatibilidad entre las metas y los pronósticos del modelo bajo una prueba estadística. Adicionalmente, una aplicación del método se lleva a cabo utilizando unos modelos simulados.

Fuente: https://www.banrep.gov.co/es/pronosticos-condicionados-para-modelos-var