

Ejercicio 3 Considere el siguiente proceso VAR:

$$Y_{1,t} = 0,3Y_{1,t-1} + 0,8Y_{2,t-1} + \varepsilon_{1,t} \quad (1)$$

$$Y_{2,t} = 0,9Y_{1,t-1} + 0,4Y_{2,t-1} + \varepsilon_{2,t} \quad (2)$$

con $E[\varepsilon_{1,t}; \varepsilon_{2,s}] = 0$ para todo t, s . A partir de esto, calcule $\frac{\partial Y_{t+s}}{\partial \varepsilon_t} = X_s$ para $s = 0, 1, 2, \dots$.
¿Cuál es el límite cuando $s \rightarrow \infty$? “