## "latex Fuente: Ayudantía N°7 de Econometría II, Primavera 2022

Ejercicio 3 Considere el siguiente proceso VAR:

$$Y_{1,t} = 0.3Y_{1,t-1} + 0.8Y_{2,t-1} + \varepsilon_{1,t} \tag{1}$$

$$Y_{2,t} = 0.9Y_{1,t-1} + 0.4Y_{2,t-1} + \varepsilon_{2,t}$$
 (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,...; Cuál es el límite cuando  $s\to\infty$ ? "'