

1 Modelos VAR: breve resumen

Siguiendo a Enders(año), cuando no se tiene seguridad si una variable es exógena en un sistema, una solución en el sentido de funciones de transferencia es considerar a cada variable de forma simétrica. Para el caso bivariado, se tiene el siguiente sistema:

$$y_t = b_{10} - b_{12}z_t \quad (1)$$

$$z_t = d \quad (2)$$

Otra forma:

2 Aplicaciones VAR