Archivos en esta carpeta:

Los archivos en esta carpeta sirven para replicar los resultados en el paper de Diebold, Rudebusch, y Aruoba, “The macroeconomy and the yield curve: a dynamic latent factor approach”. Journal of Econometrics, 2006.

La siguiente es la lista de archivos que hay en la carpeta y lo que hacen:

* run\_dns.m: Programa que replica el paper de Diebold, Rudebusch y Aruoba. Hace la estimación MLE, reporta datos, errores estándar y hace algunos gráficos.
* mle\_dns.m: este programa hace la estimación MLE. Es llamado por run\_dns.m
* transform\_dns.m: programa que transforma parámetros sin restricciones a parámetros con restricciones para facilitar la optimización del log-likelihood.
* Programas adicionales:
  + anneal.m: optimizador usando el método de simulated annealing.
  + uncmin.m, umlnmin.m y umstop.m: optimizador Quasi-Newton de Ellen McGrattan. Muchas veces es mejor que el optimizador base de Matlab fminunc.m
  + fdhess.m: programa para computar el Hessiano numérico de una función cualquiera. Acá lo usamos para encontrar el Hessiano del log-likelihood para computer los errors estándar de los parámetros.
  + fdjacob.m: programa para calcular el Jacobiano numérico de una función vectorial. Lo usamos para aplicar el método delta para encontrar los errores estándar de los parámetros que nos interesan.