**Guión Modelos Vectoriales Autoregresivos (VAR)**

Switching VAR (Hamilton y Jesus)

VAR-BEKK (Jesus?)

* Un modelo dinámico estructural de ecuaciones simultáneas
* El modelo VAR(1)
* Identificación en un modelo VAR
* Estimación de un modelo VAR
* VAR y modelos univariantes
* Ejemplo: Modelo VAR en EVIEWS/GRETL
* Contrastación de hipótesis
	+ La descomposición de Cholesky
	+ Contrastes de especificación
	+ Contrastes de causalidad
* Representación MA de un modelo VAR
* Funciones de respuesta al impulso
* Descomposición de la varianza
* Matlab para VAR and cointegration

Cointegración

* Regresión espúrea
* Cointegracion (14.7 en Econometría – Novales).
* Ejemplo en EVIEWS/GRETL, RATS o MATLAB [*Ejemplo\_coint.pdf*]
* Aplicaciones: [*Cointegration papers.rar* de C. Alexander]
	+ Case Study II.5: Index Tracking
	+ Case Study II.5: Pairs Trading [*Tesina Aitor Fiz*]
* Contrastes de cointegracion
	+ enfoque de Engle-Granger
	+ enfoque de Johansen
* Modelo en ausencia de cointegración
* El modelo de corrección del error (14.7 en Econometría – Novales)
* Cointegración por umbrales
* Estructuras GARCH en el modelo VAR: El modelo VAR-BEKK