

**ESTIMACION Y PRONOSTICOS DE SERIES DE TIEMPO MULTIVARIADAS**

**CÓDIGOS**

UNR 1ECO15  
 Programa de Incentivos 19/E097

**FECHAS**

Inicio 2003  
 Finalización 2005

**RADICACIÓN**

Instituto Instituto de Investigaciones Teóricas y Aplicadas  
 Escuela Estadística

**CAMPO**

Disciplina Científica Matemática  
 Especialidad Estadística  
 Campo de Aplicación Estadística

**RESUMEN**

Los modelos multivariados de series de tiempo comienzan a desarrollarse en los ochenta. Son modelos pioneros los: VAR (Tiao y Box y, 1981), de corrección de error para series cointegradas (Engle y Granger, 1987) y estructurales multivariados (Harvey, 1989).

Existen controversias sobre cuáles modelos se desempeñan mejor, las más candentes son sobre: Modelos VAR, cointegración y series estacionales y cointegración. El objetivo es comparar las bondades de la especificación y estimación de modelos multivariados de series de tiempo, particularmente los modelos de Harvey (1989) y los modelos VAR irrestrictos y restrictos con el fin de realizar pronósticos referidos a series del país.

La metodología a seguir consta de dos tópicos: métodos de simulación y análisis empíricos aplicados a series argentinas.

**PALABRAS CLAVE**

Series temporales    Modelo estructura    Modelo VAR    Cointegración    pronóstico

**GRUPO DE INVESTIGACIÓN**

<i>Apellido y Nombre</i>	<i>Dedicación</i>	<i>Función</i>	<i>Categoría Incentivos</i>	<i>Participación</i>
Blaconá, María Teresa	Exclusiva	Directora	II	2003-2005
Bussi, Javier	Exclusiva	Integrante	IV	2003-2005
Ventroni, Nora	Semiexclusiva	Integrante	IV	2003-2005

**RESOLUCIONES DEL CONSEJO SUPERIOR**

<i>Acreditación</i>		<i>Continuidad</i>		<i>Continuidad</i>		<i>Continuidad</i>		<i>Aprobación Informe Final</i>
C.S.Nº		C.S.Nº		C.S.Nº		C.S.Nº		C.S.Nº
315/2003		403/2004		517/2005				
Fecha 21/10/2003		Fecha 12/08/2004		Fecha		Fecha		Fecha

**FINANCIAMIENTO**

<i>Año</i>	<i>Año</i>	<i>Año</i>	<i>Año</i>	-
<i>Monto Rector Nº</i>	<i>Monto Rector Nº</i>	<i>Monto Rector Nº</i>	<i>Monto Rector Nº</i>	
<i>Fecha</i>	<i>Fecha</i>	<i>Fecha</i>	<i>Fecha</i>	

**Programa de Incentivos a los Docentes-Investigadores**

Producción del proyecto en:

<http://incentivos-spu.me.gov.ar/Direct0203/revis-proy.php>  
<http://incentivos-spu.me.gov.ar/Direct0203/difus-proy.php>