Cointegration Vector Estimation by Dols for a Three-Dimensional Panel

Borradores de Economia
Número:
474
Publicado:
Sábado, 1 Diciembre 2007
Clasificación JEL:
C13, C33
Palabras clave:
Cointegration, Dynamic OLS estimation, panel data in three dimensions
Descargar documento

Lo más reciente

La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados
Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez
Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen
Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew
Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un modelo XGBoost
Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola
Otras Publicaciones

This paper extends the asymptotic results of the dynamic ordinary least squares (DOLS) cointegration vector estimator of Mark and Sul (2003) to a three-dimensional panel. We use a balanced panel of N and M lengths observed over T time periods. The cointeg