

Cointegration Vector Estimation by Dols for a Three-Dimensional Panel

Borradores de Economía

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

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[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