

BVAR: Bayesian Vector Autoregressions

23.12.2023/24.12.2023/26.12.2023
12:20

Лысенко Глеб

Идеи байесовских методов, сэмплирование по Гиббсу на примере BVAR

1. Идея байесовской оценки
2. Сэмплирование по Гиббсу – «рабочая лошадка» байесовских методов
3. Преимущества байесовской оценки для VAR

Идентификация структурных шоков в VAR на основе знаковых ограничений

1. Подходы к идентификации в VAR
2. Оценка структурных шоков на основе знаковых ограничений
3. Преимущества и недостатки знаковых ограничений

Анализ BVAR

1. Введение экзогенной переменной
2. Алгоритм построения:
 - импульсных откликов
 - исторических декомпозиций
 - декомпозиции дисперсии ошибки прогноза