

Título: MODELOS DE SERIES TEMPORALES CON RUPTURAS TENDENCIALES Y ESTRUCTURAS CICLICAS ASIMETRICAS Y BRUSCAS

Nombre: SENRA DIAZ, EVA

Universidad: Universidad Carlos III de Madrid

Departamento: ESTADISTICA Y ECONOMETRIA

Fecha de lectura: 25/05/1998

Programa de doctorado: Economía

Dirección:

> **Director:** ANTONI ESPASA TERRADES

Tribunal:

> **presidente:** Daniel Peña Sánchez de Rivera

> **secretario:** ESTHER RUÍZ ORTEGA

> **vocal:** JUAN IGNACIO PEÑA SÁNCHEZ DE RIVERA

> **vocal:** CANCELO DE LA TORRE J. RAMON

> **vocal:** AGUSTÍN MARAVALL HERRERO

Descriptores:

> MATEMATICAS

> TEORIA ESTOCASTICA Y ANALISIS DE SERIES TEMPORALES

> ESTADISTICA

El fichero de tesis no ha sido incorporado al sistema.

Resumen: Se estudia el problema de la evolución tendencial de las series economicas.

El trabajo esta organizado en tres capitulos, siendo el capitulo de union entre ellos la descripcion del comportamiento sintematico a crecer con posibles cambios esporadicos de pendiente, asi como comportamientos ciclicos asimetricos y bruscos de las series economicas.

Se analizan las principales referencias bibliograficas relacionadas con el analisis o la modelización de la tendencia y de los comportamientos ciclicos mencionados que muestran las series economicas, analizando las diferencias y similitudes entre los diferentes esquemas propuestos para tal fin en la literatura y obtener conclusiones sobre el tipo de estructuras que pueden ser más relevantes.

Se propone un nuevo tipo de modelo denominado de "raices unitarias cambiantes" que

se engloba dentro de los modelos vistos anteriormente, presentandose como una alternativa aceptable.

Se extiende a un contexto econométrico el hecho de que cambios esporádicos de tendencia y las asimetrías cíclicas y bruscas pueden afectar también a las relaciones a largo plazo entre variables económicas. Este hecho se ilustra con un modelo econométrico no lineal para la inversión española en función del PIB y otras variables relevantes.

El autor aporta una serie de conclusiones extraídas de los análisis que realiza. Concluye que la elasticidad a largo plazo entre las variables no es un parámetro constante.

Se incluye lista de referencias bibliográficas.