

Título: ANÁLISIS DE ESTACIONARIEDAD Y RUPTURA ESTRUCTURAL. UN ESTUDIO ASINTÓTICO Y DE SIMULACIÓN

Nombre: PRESNO CASQUERO, M. JOSE

Universidad: Universidad de Oviedo

Departamento: Economía aplicada

Fecha de lectura: 05/04/2001

Programa de doctorado: MÉTODOS CUANTITATIVOS PARA LA ECONOMIA (DEPARTAMENTO DE MATEMÁTICAS)

Dirección:

- > **Director:** Rigoberto Pérez Suárez
- > **Codirector:** Ana Jesús López Menéndez

Tribunal:

- > **presidente:** ANTONIO PULIDO SAN ROMÁN
- > **secretario:** CÁNDIDO PAÑEDA FERNÁNDEZ
- > **vocal:** GIL ÁLVAREZ PEDRO ÁNGEL
- > **vocal:** ARIELLE BEYAERT STEVENS
- > **vocal:** FRANCISCO JAVIER TRIVEZ BIELSA

Descriptor:

- > MATEMATICAS
- > ESTADISTICA
- > TEORIA ESTOCASTICA Y ANALISIS DE SERIES TEMPORALES
- > SERIES TEMPORALES ECONOMICAS
- > SERIES TEMPORALES
- > CIENCIAS ECONOMICAS
- > ECONOMETRIA
- > TECNICAS DE PREDICION ESTADISTICA

El fichero de tesis no ha sido incorporado al sistema.

Localización: DEPARTAMENTO DE ADMINISTRACIÓN DE EMPRESAS Y CONTABILIDAD FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES UNIVERSIDAD DE OVIEDO AVDA. DEL CRISTO S/N 33071 OVIEDO

Resumen: A lo largo de la pasada década se han realizado distintos estudios en torno a los efectos de las rupturas estructurales sobre los contrastes

de raíz unitaria y las propuestas de aplicación de este tipo de herramientas para posibilitar el análisis de series afectadas por cambios estructurales. No obstante, han sido escasos los intentos de estudiar los contrastes de estacionariedad bajo estas circunstancias, tarea que se aborda en este trabajo.

Como un primer acercamiento al problema se estudia el comportamiento asintótico del estadístico de contraste, demostrando su divergencia, y mediante un estudio de Monte Carlo se comprueba que en muestras finitas surgen importantes distorsiones en el tamaño del tst de estacionariedad que llevan a rechazar erróneamente este supuesto. Dado este deficiente comportamiento, se propone una extensión del contraste de estacionariedad que permite el estudio de series con cambios determinados exógenamente que afectan a su nivel y/o a su tasa de crecimiento derivando la distribución asintótica del estadístico mediante el enfoque de Fredholm. De modo complementario se obtienen superficies de respuesta que posibilitan la obtención de los valores críticos de los contrastes modificados para diferentes tamaños muestrales y posiciones relativas de cambio.

Con el fin de comprobar el funcionamiento de estos contrastes bajo distintas situaciones, se analiza el efecto sobre el tamaño y la potencia de factores como la magnitud de la ruptura, suposición relativa, las consecuencias de una especificación errónea del modelo o la posibilidad de errores en la determinación del punto de ruptura. Finalmente se dedica un capítulo al

estudio del comportamiento de las herramientas desarrolladas sobre algunas series económicas, que ilustran sus ventajas y permiten extraer algunas conclusiones de interés.