

Título *Un estudio Comparativo del Comportamiento de Distintos Contrastes de Raíz Unitaria y de Estacionariedad en Series Temporales*

Resumen

Frente al problema de baja potencia que presentan muchos de los contrastes de raíz unitaria (estacionariedad en diferencias) habituales en la literatura, se ha planteado recientemente la conveniencia de complementar los resultados de estos procedimientos con los de alguno(s) basado en el contraste de la hipótesis nula de estacionariedad no homogénea (estacionariedad en torno a un componente determinista).

En este sentido, nos planteamos hacer una revisión de algunos de los contrastes de la hipótesis de raíz unitaria y de estacionariedad más ampliamente utilizados así como de algunas de las propuestas más recientes en ambos casos, con la finalidad de comparar (Análisis Confirmatorio) los resultados que proporcionan para un amplio conjunto de series temporales reales frecuentemente analizadas bajo distintas metodologías.

Concretamente, tanto para los contrastes de raíz unitaria como de estacionariedad consideramos especialmente relevante fijarnos en la variedad de resultados a que pueden conducir las distintas propuestas, paramétricas y no paramétricas, para el tratamiento de perturbaciones no ruido blanco (no IID).

Martín	Rodríguez	Gloria	gmartinr@ull.es
Afonso	Rodríguez	Julio A.	jafonsor@ull.es
Guirao	Pérez	Ginés	gguirao@ull.es