

 Contenuto archiviato il 2024-05-27



# New Results on Structural Change Tests: Theory and Applications

## Risultati in breve

### Nuovi metodi e teorie per rilevare e verificare più efficacemente i fenomeni economici

Un'iniziativa dell'UE ha consentito ai test sul cambiamento strutturale o sul momento di cambiamento di progredire, con conseguenti contributi ai campi dell'econometria e dell'economia.



© Shutterstock

Il progetto CHANGE-POINT TESTS (New results on structural change tests: Theory and applications), finanziato dall'UE, si è proposto di realizzare due obiettivi principali. Il primo riguardava la predisposizione di nuove tecniche per affrontare il problema del potere non monotono di un grande gruppo di test di rotture strutturali ampiamente utilizzati in econometria e statistica, nonché per dimostrare che tali tecniche presentano ulteriori apporti.

L'altro obiettivo si articolava in tre parti. Si intendeva innanzitutto dimostrare che, trascurando i cambiamenti strutturali nelle serie storiche finanziarie, si conseguono stime parziali e disomogenee della gestione del rischio, che portano in definitiva alla ripartizione inadeguata degli investimenti. In secondo luogo, si intendeva proporre metodi per valutare la stabilità delle serie storiche finanziarie utilizzabili come processo di controllo della qualità per la gestione del rischio finanziario, dimostrando

anche che il monitoraggio delle volatilità implicate conduce a indicatori ad preavviso di una struttura di rischio in fase di cambiamento. In ultimo, si mirava a proporre modalità originali per creare una statistica circa il momento del cambiamento sulla base di previsioni, in grado di ridurre i ritardi di rilevazione registrati da test sequenziali attuali e capace di indicare la probabilità di un cambiamento strutturale.

In particolare, i partner del progetto hanno sviluppato un'analisi della statistica dei test con errore di stima per i test di specificazione residui o estimatori a due fasi. Hanno anche ideato una teoria asintotica di tali test applicabile a vari requisiti econometrici, a condizione che soddisfino determinate condizioni. I ricercatori hanno anche proposto applicazioni dell'analisi asintotica a modelli di serie storiche e a scelta discreta.

Introducendo un nuovo estimatore, il team di CHANGE-POINT TESTS ha scoperto una soluzione riguardante test statistici che non riescono a rilevare i cambiamenti nei processi economici o cambiamenti strutturali. Inoltre, ha valutato le proprietà di un gruppo recentemente proposto di modelli di serie storiche in cui la variabile dipendente nella regressione viene osservata a una diversa frequenza di campionamento rispetto alle variabili indipendenti nella regressione. I componenti del progetto hanno dimostrato che ignorando le varie frequenze di campionamento delle differenti variabili economiche si possono ottenere problemi di inferenza statistica. Hanno poi applicato tali modelli a una vasta molteplicità di campi dell'economia.

CHANGE-POINT TESTS presenta effetti diretti sulla ricerca in economia e consente ai settori bancari americano ed europeo di analizzare meglio la politica economica.

## Parole chiave

[Cambiamento strutturale](#)

[CHANGE-POINT TESTS](#)

[econometria](#)

[serie storiche finanziarie](#)

**Scopri altri articoli nello stesso settore di applicazione**

## Un ispettore robot controlla i serbatoi industriali dall'interno



18 Ottobre 2019 



## Trarre ispirazione dalla natura per costruire l'habitat umano del futuro

18 Luglio 2023 



## Uno Sherlock dei nostri giorni si occupa della disponibilità e della sicurezza del nostro cibo

18 Marzo 2019  

### Informazioni relative al progetto

#### CHANGE-POINT TESTS

ID dell'accordo di sovvenzione: 209116

Progetto chiuso

#### Data di avvio

1 Settembre 2008

#### Data di completamento

31 Agosto 2013

#### Finanziato da

Specific programme: "Ideas" implementing the Seventh Framework Programme of the European Community for research, technological development and demonstration activities (2007 to 2013)

#### Costo totale

€ 517 200,00

#### Contributo UE

€ 517 200,00

**Ultimo aggiornamento:** 2 Agosto 2016

**Permalink:** <https://cordis.europa.eu/article/id/183160-novel-methods-and-theories-for-better-detection-and-testing-of-economic-phenomena/it>

European Union, 2025