

TALLER QUIEBRE ESTRUCTURAL

Universidad: Universidad del Quindío

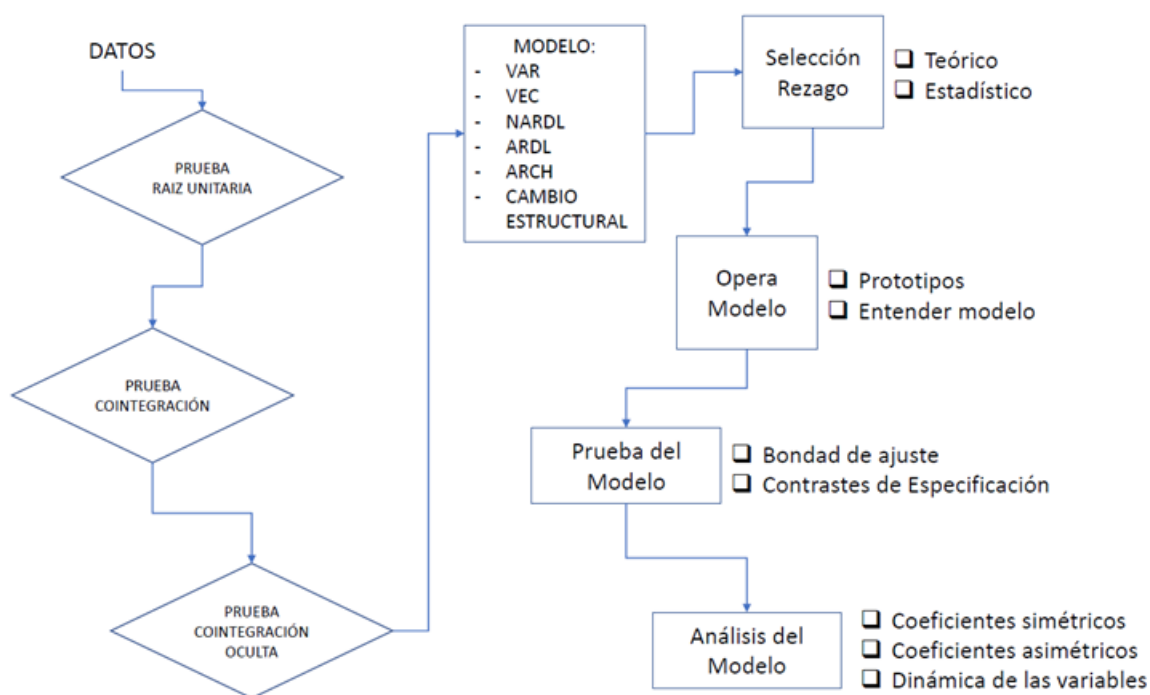
Pre-grado: Economía

Curso: Econometría II

Fecha: 2 de noviembre de 2023 (Entregar en una hoja.)

Base de datos: Exportaciones

1. Tomar la base de datos y depurar un departamento a elección del estudiante.
2. Aplicar las pruebas de raíz unitaria.
3. Aplicar los modelos de Quiebre Estructural.



```
library(tidyverse)
library(strucchange)
library(timeSeries)
```

```
EXP = haven::read_dta(file = "PATH.dta" , encoding = "UTF-8" )
|> data.frame()
```

```
EXP |> str(list = 9 )
```

```

## GENERAL -----
skimr::skim(data = EXP )

## Filtrar el dept
EXP_ARMENIA = EXP |> dplyr::filter( ORIGEN == "63")

## Agrupo la serie trimestral
EXP_ARMENIA = EXP_ARMENIA |>
dplyr::group_by( A O _N , TRIMESTRES) |>
dplyr::summarise(TOTAL = sum(I_DOLARES) )

## Establezco una serie temporal
SERIE = ts(EXP_ARMENIA$TOTAL , start = c(2005, 1)
, end = c(2021 , 4) , frequency = 4)

plot(SERIE)

#Diferenciar si no es estacionaria
D_SERIE = diff(SERIE,1)

plot(D_SERIE)

CE = breakpoints(D_SERIE ~ D_SERIE , h = 0.1)

summary(CE)

plot(CE)

plot(D_SERIE)

lines(CE , breaks = 3 , col = "blue" )

```