



CRECIMIENTO REGIONAL Y EFECTO COMPETITIVO: MODELIZACIÓN ECONOMETRICA Y PREDICCIÓN

Autor:

Matías Mayor Fernández

Directores:

Dra. Ana Jesús López Menéndez

Dr. Rigoberto Pérez Suárez

Fecha de lectura:

6 de febrero de 2007

Resumen

El objetivo fundamental es analizar las disparidades existentes en los ritmos de crecimiento regional, identificando sus componentes y factores explicativos y tratando de pronosticar su comportamiento. Este estudio puede ser abordado mediante diferentes técnicas entre las cuales se encuentra el análisis shift-share que permite identificar tres efectos: nacional, sectorial y competitivo. El efecto competitivo recoge el espacial dinamismo que presenta un sector en una región determinada en comparación con la evolución nacional de ese sector, de ahí la importancia de medir adecuadamente este componente y tratar de anticipar su evolución.

Sin embargo, el análisis shift-share presenta limitaciones como son la ausencia de tratamiento inferencial y la no inclusión explícita de la dependencia espacial. Con el fin de dotar de análisis inferencial a esta técnica se plantea el análisis shift-share estocástico y los diferentes procedimientos que permiten la estimación de los efectos sectoriales y regionales y su contraste.

Las nuevas teorías de crecimiento económico otorgan un papel creciente al espacio, por lo que se proponen nuevos modelos shift-share espaciales, unos basados en la matriz de pesos espaciales y otros en el procedimiento previo de filtrado espacial de las variables. Estos nuevos modelos permiten la cuantificación explícita de la dependencia espacial en términos de la variable económica analizada así como la obtención de un efecto competitivo libre de la influencia espacial.

También se proponen diferentes alternativas para la elaboración de predicciones regionales a partir del efecto competitivo como rasgo diferenciador de cada una de las regiones. Se analizan diversas alternativas desde modelos ingenuos hasta modelos espacio-temporales (STARIMAG y SVAR), así como escenarios de predicción basados en el análisis shift-share dinámico.

Palabras clave: análisis shift-share, autocorrelación espacial, predicción.

REGIONAL GROWTH AND COMPETITIVE EFFECT: ECONOMETRIC MODELLING AND FORECASTING

Abstract

This Doctoral Thesis aims to analyze the existing disparities in the rhythms of regional growth, identifying its components and trying to forecast its future behaviour. With this objective different statistical-econometric techniques are used introducing some theoretical proposals which are also implemented in several empirical applications relating to the evolution of the employment at the European, national and regional level. The starting point of this analysis is the classical shift-share model, allowing to express the variation of a magnitude as sum of three components, which are respectively known as national, sectoral and competitive effects. We mainly focus in this last term, since it allows to quantify the deviation of the sectoral behaviour of a specific region with regard to the national framework.

Since the shift-share analysis presents some limitations, this research provides some proposals referred to the weights, the dynamic analysis (suggesting a combined use with econometric techniques) and the spatial interaction (developing some new proposals referred to the definition of homothetic effects, the spatial weights matrix and the introduction of spatial filtering).

Key words: shift-share analysis, spatial autocorrelation, forecasting.