



Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

PLAN DE ESTUDIOS (PE): Licenciatura en Finanzas

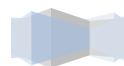
ÁREA: Matemáticas

ASIGNATURA: ECONOMETRÍA FINANCIERA

CÓDIGO: LFIS

CRÉDITOS: 4

FECHA: 29 de junio de 2016





Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

1. DATOS GENERALES

Nivel Educativo:	Licenciatura
Nombre del Plan de Estudios:	Licenciatura en Finanzas
Modalidad Académica:	Escolarizada
Nombre de la Asignatura:	ECONOMETRÍA FINANCIERA
Ubicación:	Nivel FORMATIVO
Correlación:	
Asignaturas Precedentes:	ECONOMETRIA I
Asignaturas Consecuentes:	No aplica
Conocimientos, habilidades, actitudes y valores previos:	

2. CARGA HORARIA DEL ESTUDIANTE (Ver matriz 1)

Concepto	Horas por periodo		Total de horas por periodo	Número de créditos
	Teoría	Práctica		
Horas teoría y práctica <i>Actividades bajo la conducción del docente como clases teóricas, prácticas de laboratorio, talleres, cursos por internet, seminarios, etc.</i> (16 horas = 1 crédito)	2	2	72	4
Total	2	2	72	4





Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

3. REVISIONES Y ACTUALIZACIONES

Autores:	ESTRADA QUIROZ LILIANA GARCÍA PÉREZ ISRAEL GERARDO GUILLERMO PEÓN SYLVIA BEATRIZ HARO ÁLVAREZ GONZALO
Fecha de diseño:	Marzo 2015
Fecha de la última actualización:	28 de junio de 2016
Fecha de aprobación por parte de la academia de área	29 de junio de 2016
Fecha de aprobación por parte de CDESC-UA	
Fecha de revisión del Secretario Académico	
Revisores:	ESTRADA QUIROZ LILIANA GARCÍA PÉREZ ISRAEL GERARDO GUILLERMO PEÓN SYLVIA BEATRIZ HARO ÁLVAREZ GONZALO
Sinopsis de la revisión y/o actualización:	<p><i>Se eliminó la sección de Econometría de Datos Panel, con la finalidad de agregar los modelos de vectores de corrección de errores y de vectores autorregresivos.</i></p> <p><i>Se modificaron en su totalidad los objetivos general y particulares de acuerdo a los contenidos de cada unidad</i></p> <p><i>Se reformuló en su totalidad el temario ya que solo contenía 3 unidades.</i></p> <p><i>Se crearon los puntos 6; 8 y 9.</i> <i>Se adecuaron los puntos 10-12</i></p> <p><i>Se actualizó la bibliografía, acorde al nuevo temario.</i></p>

4. PERFIL DESEABLE DEL PROFESOR (A) PARA IMPARTIR LA ASIGNATURA:

Disciplina profesional:	ECONOMÍA Y FINANZAS CON ESPECIALIDAD EN ECONOMETRÍA
Nivel académico:	MAESTRÍA O DOCTORADO
Experiencia docente:	2 años
Experiencia profesional:	2 años





Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

5. OBJETIVOS:

5.1 General:

Proporcionar al alumno los conocimientos de métodos de estimación de modelos de regresión alternativos al de Mínimos Cuadrados, así como introducir al alumno en modelos de regresión con variable dependiente limitada. Adicionalmente, se introducirá al alumno en el análisis de Series de Tiempo.

5.2 Específicos:

Que el alumno:

Comprenda los problemas de estimación que surgen cuando el modelo no es correctamente especificado o existen errores de medición en las variables explicativas.

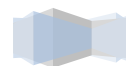
Aprenda la metodología para estimación de modelos con variable dependiente cualitativa y limitada; así como la interpretación de los resultados de estimación.

Se introduzca al análisis de modelos dinámicos

Comprenda la diferencia entre procesos de series de tiempo estacionarias y no estacionarias, y las técnicas utilizadas para modelar y estimar en cada caso, así como las pruebas para detectar series no estacionarias

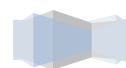
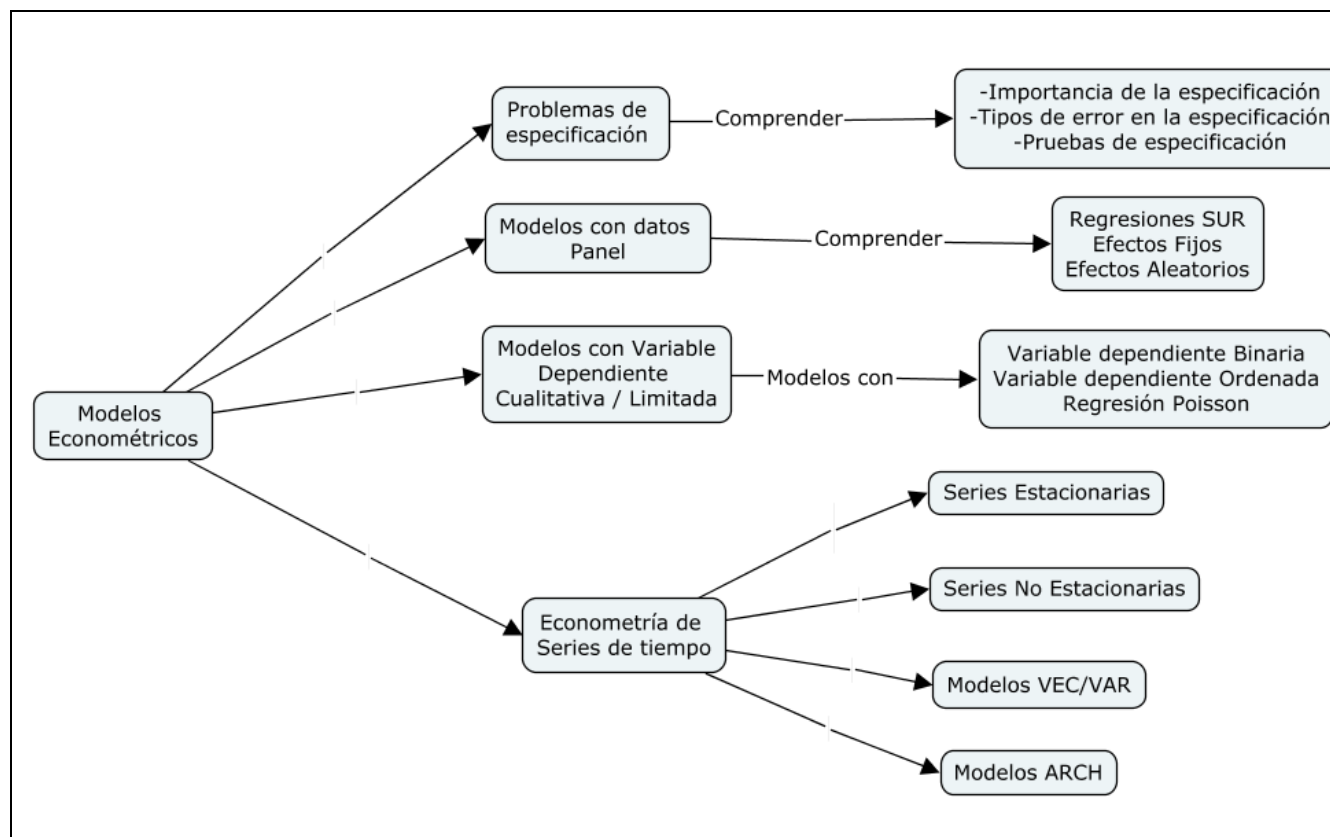
Comprenda el por qué dos series de tiempo son dinámicamente independientes, así como también explique lo que es un modelo con corrección de errores y pueda distinguirlo de un modelo VAR.

Se introduzca a la econometría financiera y pueda distinguir entre series de tiempo con varianza cambiante en el tiempo y series de tiempo con varianza constante, para poder modelar estos procesos adecuadamente.





6. REPRESENTACIÓN GRÁFICA DE LA ASIGNATURA:





Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

7. CONTENIDO

Unidad	Objetivo Específico	Contenido temático/actividades de aprendizaje	Bibliografía	
			Básica	Complementaria
[I] Algunos Problemas de Especificación y Datos en los Modelos Econométricos	Que el alumno comprenda los problemas de estimación que surgen cuando el modelo no es correctamente especificado o existen errores de medición en las variables explicativas.	1.1 Inclusión de Variables Irrelevantes en un modelo de regresión. 1.2 Sesgo por omisión de Variables relevantes 1.3 Especificación Incorrecta de la Forma Funcional. Prueba RESET. 1.4 Error de medición en las variables	Hill R. Carter; Griffiths William E.; Lim Guay C. (2011) Principles of Econometrics 4 th Ed. John Wiley.	Adkins Lee C.; Hill R. Carter (2011) Using Stata for Principles of Econometrics. 4th Ed. John Wiley Gujarati Damodar N.; Porter Dawn C. (2010) Econometría 5 ^a Ed. McGraw Hill. Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Introducción a la Econometría Un enfoque moderno. CENGAGE.
II. Modelos con Variable Dependiente Cualitativa y limitada.	Que el alumno aprenda la metodología para estimación de modelos con variable dependiente cualitativa y limitada; así como la interpretación de los resultados de estimación.	2.1 Modelos con variable dependiente binaria -Modelo de Probabilidad Lineal -Modelo Probit -Modelo Logit 2.2 Modelo Probit para alternativas ordenadas 2.3 Regresión Poisson	Hill R. Carter; Griffiths William E.; Lim Guay C. (2011) Principles of Econometrics 4 th Ed. John Wiley.	Adkins Lee C.; Hill R. Carter (2011) Using Stata for Principles of Econometrics. 4th Ed. John Wiley Maddala G.S(1986) Limited dependent and qualitative variables in econometrics



Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

				Greene William H.; Hensher David A. (2010) Modeling ordered choices Cambridge University press
III Introducción a Series de Tiempo estacionarias: Modelos Autorregresivos y de Rezagos Distribuidos	Introducir al alumno al análisis de modelos dinámicos	3.1 El papel del tiempo o rezagos 3.2 Modelo de Rezagos Distribuidos Finitos 3.2.1 Modelo con rezagos polinomiales (enfoque de Almon) 3.3 Modelo de rezagos Distribuidos Infinitos 3.3.1 Enfoque de Koyck para modelos de rezagos distribuidos 3.4 Modelos Autorregresivos y con rezagos distribuidos	Hill R. Carter; Griffiths William E.; Lim Guay C. (2011) Principles of Econometrics 4 th Ed. John Wiley.	Adkins Lee C.; Hill R. Carter (2011) Using Stata for Principles of Econometrics. 4th Ed. John Wiley Gujarati Damodar N.; Porter Dawn C. (2010) Econometría 5 ^a Ed. McGraw Hill.
IV. Modelos de Series de Tiempo Estacionarias y No Estacionarias	Que el alumno comprenda la diferencia entre procesos de series de tiempo estacionarias y no estacionarias, y las técnicas utilizadas para modelar y estimar en cada caso, así como las pruebas para detectar series no estacionarias.	4.1 Variables estacionarias y no estacionarias 4.2 Modelos autorregresivos de primer orden 4.3 Modelos Autorregresivos de segundo orden y de orden P 4.4 Prueba de Estacionariedad basada en el Correlograma 4.5 Procesos estocásticos estacionarios alrededor de una tendencia determinística	Hill R. Carter; Griffiths William E.; Lim Guay C. (2011) Principles of Econometrics 4 th Ed. John Wiley.	Adkins Lee C.; Hill R. Carter (2011) Using Stata for Principles of Econometrics. 4th Ed. John Wiley Gujarati Damodar N.; Porter Dawn C. (2010) Econometría 5 ^a Ed. McGraw Hill. Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Introducción a la



Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

		<p>4.6 Modelos de Caminata Aleatoria (tendencia estocástica)</p> <p>4.7 Regresión espuria</p> <p>4.8 Pruebas de Raíces Unitarias</p> <p>4.9 Orden de Integración</p> <p>4.10 Cointegración</p> <p>4.11 Regresión cuando no hay cointegración</p>		Econometría. Un enfoque moderno. CENGAGE.
<p>V. Modelos de Vectores de Corrección de Errores (VEC) y Modelos de Vectores Autorregresivos (VAR)</p>	<p>Que el alumno comprenda el por qué dos series de tiempo son dinámicamente independientes, así como también explique lo que es un modelo con corrección de errores y pueda distinguirlo de un modelo VAR.</p>	<p>5.1 Modelo Uniecuacional con corrección de errores</p> <p>5.2 Modelos de Vectores con Corrección de Errores (VEC)</p> <p>5.3 Modelos de Vectores Autorregresivos</p> <p>5.4 Funciones de Impulso-Respuesta y Descomposición de Varianza</p>	<p>Hill R. Carter; Griffiths William E.; Lim Guay C. (2011) Principles of Econometrics 4th Ed. John Wiley.</p>	<p>Adkins Lee C.; Hill R. Carter (2011) Using Stata for Principles of Econometrics. 4th Ed. John Wiley</p> <p>Gujarati Damodar N.; Porter Dawn C. (2010) Econometría 5^a Ed. McGraw Hill.</p> <p>Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. CENGAGE.</p>
<p>VI. Volatilidad Cambiante en el tiempo y Modelos ARCH</p>	<p>Introducir al alumno a la econometría financiera. Que el alumno pueda distinguir entre series de tiempo con varianza cambiante en el tiempo y series de tiempo con varianza constante, para poder modelar estos</p>	<p>6.1 Modelos Autorregresivos con heteroscedasticidad condicional (ARCH)</p> <p>6.2 Volatilidad cambiante en el tiempo</p> <p>6.3 Prueba, estimación y pronóstico para modelo ARCH</p> <p>6.4 Modelos GARCH</p>	<p>Hill R. Carter; Griffiths William E.; Lim Guay C. (2011) Principles of Econometrics 4th Ed. John Wiley.</p>	<p>Adkins Lee C.; Hill R. Carter (2011) Using Stata for Principles of Econometrics. 4th Ed. John Wiley</p> <p>Gujarati Damodar N.; Porter Dawn C. (2010)</p>



Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

	procesos adecuadamente.			Econometría 5ª Ed. McGraw Hill. Wooldridge, Jeffrey M. (2010). Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno. CENGAGE.
--	-------------------------	--	--	---

Nota: La bibliografía deberá ser amplia, actualizada (no mayor a cinco años) con ligas, portales y páginas de Internet, se recomienda utilizar el modelo editorial que manejen en su unidad académica (APA, MLA, Chicago, etc.) para referir la [bibliografía](#)



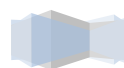
Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

8. CONTRIBUCIÓN DEL PROGRAMA DE ASIGNATURA AL PERFIL DE EGRESO

Asignatura	Perfil de egreso (anotar en las siguientes tres columnas, cómo contribuye la asignatura al perfil de egreso)		
	Conocimientos	Habilidades	Actitudes y valores
ECONOMETRIA II	<p>Adquirirá los conocimientos para identificar y resolver problemas de especificación de modelos</p> <p>Obtendrá elementos para la estimación y el análisis de modelos con variable dependiente cualitativa y limitada; así como de series de tiempo</p>	<p>Será capaz de plantear e interpretar modelos de regresión que permitan analizar problemas socioeconómicos y proporcionen una herramienta en la toma de decisiones.</p> <p>Será capaz de utilizar un software estadístico para la elaboración de modelos utilizando datos empíricos.</p>	<p>Valorará los métodos de regresión como herramienta que colabore a la comprensión de problemas de índole socioeconómica.</p>

9. Describa cómo el eje o los ejes transversales contribuyen al desarrollo de la asignatura

Eje (s) transversales	Contribución con la asignatura
Formación Humana y Social	Promoverá durante el proceso educativo el análisis de regresión.
Desarrollo de Habilidades en el uso de las Tecnologías de la Información y la Comunicación	Promoverá el uso de software estadístico y las plataformas virtuales.
Desarrollo de Habilidades del Pensamiento Complejo	Promoverá la toma de decisiones
Lengua Extranjera	El alumno requiere leer textos en inglés y utilizar software en inglés.
Innovación y Talento Universitario	Desarrollará escenarios que le permitan identificar, analizar y proponer soluciones a problemas socioeconómicos.
Educación para la Investigación	La econometría proporciona herramientas de análisis multivariado y con ello una metodología de investigación





Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

10. ORIENTACIÓN DIDÁCTICO-PEDAGÓGICA.

Estrategias y Técnicas de aprendizaje-enseñanza	Recursos didácticos
Desarrollo teórico y matemático en clase, así como la presentación de casos con datos reales.	Pizarrón Computadoras Cañón
Realización de tareas con aplicaciones a datos y casos reales	Software econométrico: Eviews, Stata, SPSS; etc.
Laboratorio-taller en el que se aprenderá la utilización del software econométrico con ejemplos prácticos	

11. CRITERIOS DE EVALUACIÓN

Criterios	Porcentaje
Evaluaciones Parciales (2)	50%
Evaluación Final (1)	40%
Tareas	10%
Total	100%

Nota: Los porcentajes de los rubros mencionados serán establecidos por la academia, de acuerdo a los objetivos de cada asignatura.

12. REQUISITOS DE ACREDITACIÓN

Obtener nota mínima aprobatoria de 6, según los criterios de evaluación.

