



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

PLAN DE ESTUDIOS (PE): Licenciatura en Finanzas

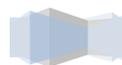
ÁREA: Matemáticas

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 |





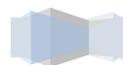
Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

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

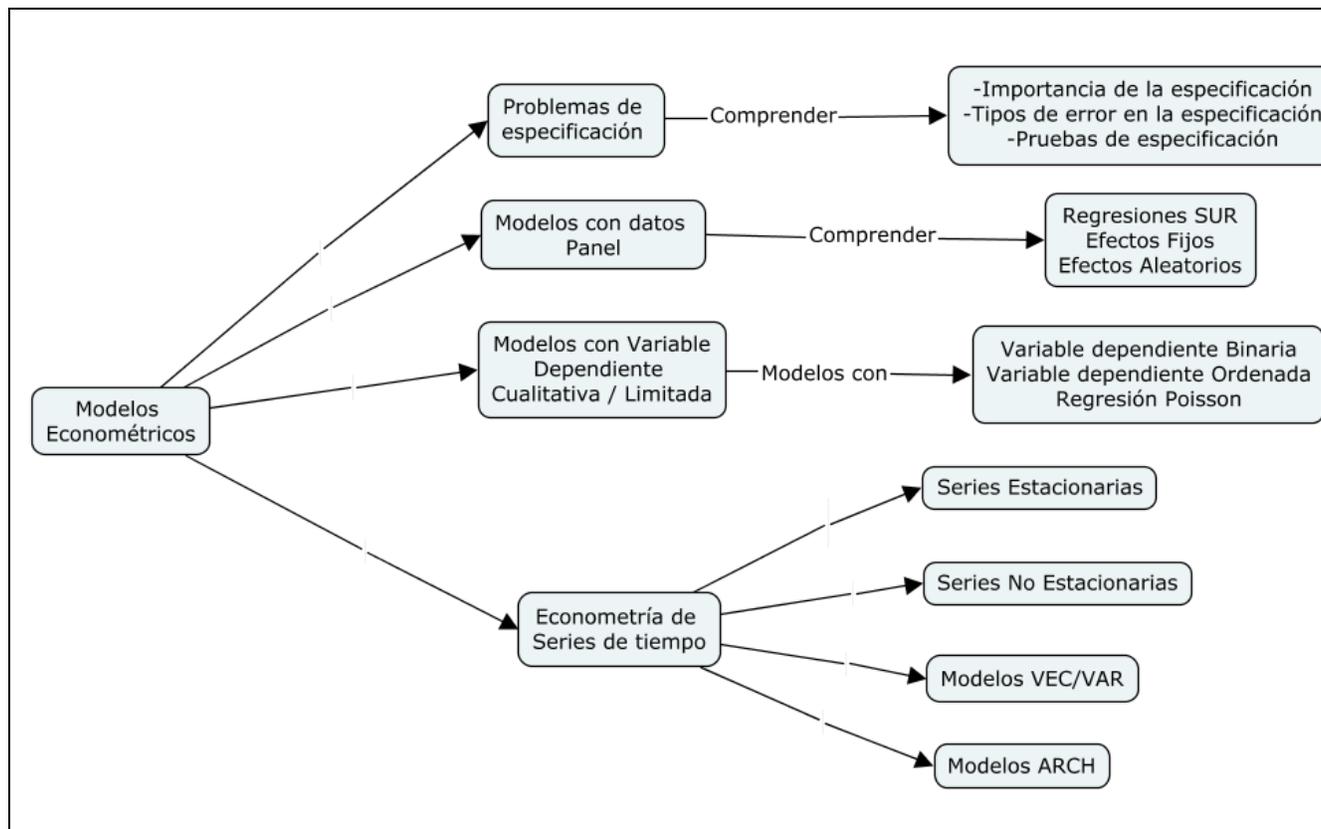
Comprenda el por qué dos series de tiempo son dinámicamente independientes, así como también explique lo que es un modelo con corrección de errores y pueda distinguirlo de un modelo VAR.

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](#)



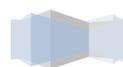
Benemérita Universidad Autónoma de Puebla
Vicerrectoría de Docencia
Dirección General de Educación Superior
Facultad de Economía

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 | Adquirirá los conocimientos para identificar y resolver problemas de especificación de modelos Obtendrá elementos para la estimación y el análisis de modelos con variable dependiente cualitativa y limitada; así como de series de tiempo | Será capaz de plantear e interpretar modelos de regresión que permitan analizar problemas socioeconómicos y proporcionen una herramienta en la toma de decisiones. Será capaz de utilizar un software estadístico para la elaboración de modelos utilizando datos empíricos. | Valorará los métodos de regresión como herramienta que colabore a la comprensión de problemas de índole socioeconómica. |

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.

