



INSTITUTO TECNOLÓGICO AUTÓNOMO DE MÉXICO
Departamento Académico de Estadística

TEMARIO

**ECONOMETRÍA FINANCIERA ACTUARIAL
EST-25146**

1. INTRODUCCIÓN

1.1 Fundamentos de Econometría Financiera

2. MODELOS ARIMA

- 2.1 Familia de modelos ARIMA
- 2.2 Identificación del modelo
- 2.3 Estimación de Parámetros
- 2.4 Validación de supuestos
- 2.5 Pronósticos con el modelo

3. MODELOS PARA SERIES DE TIEMPO ESTACIONALES

3.1 Construcción de modelos estacionales

4. MODELOS VOLATILIDAD DE SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS

- 4.1 Modelos ARCH
- 4.2 Modelos GARCH
- 4.3 Modificaciones de los modelos ARCH y GARCH



INSTITUTO TECNOLÓGICO AUTÓNOMO DE MÉXICO
Departamento Académico de Estadística

5. MODELOS PARA SERIES MÚLTIPLES

- 5.1 Vectores Autorregresivos VAR(p)
- 5.2 Cointegración

BIBLIOGRAFÍA

1. Enders, W. (1995) *Applied Econometric Time Series*. John Wiley and Sons, Inc.
2. Greene, W. (1999) *Econometric Analysis*. Prentice may 4th. Edition
3. Guerrero, G. V. M. (2009) *Análisis Estadístico y Pronóstico de Series de Tiempo Económicas*. JIT Press, 3ª edición.
4. Mills, T. C. (1999) *The Econometric Modelling of Financial Time Series*. Cambridge University Press.
5. Pindyck, R.S. y Rubinfeld, D.L. (1998) *Econometric Models and Economic Forecasts*. Mc Graw Hill, 4th. Edition