



MODELOS EN SERIES DE TIEMPO FINANCIERAS. UNA INTRODUCCIÓN

Fernando Velasco Luna¹, Francisco S. Tajonar Sanabria¹, Hugo A. Cruz Suárez¹ y Ana G. Santanero Alatoma¹

¹ Benemérita Universidad Autónoma de Puebla. fvelasco@fcfm.buap.mx

El análisis de series de tiempo, ha sido durante muchos años una parte fundamental en el estudio de los mercados financieros. Una gran parte de las series de tiempo que se estudian se producen en el campo de la economía. La teoría financiera así como las series de tiempo empíricas asociadas, están caracterizadas por un elemento de incertidumbre, característica clave que diferencia el análisis de series de tiempo en finanzas del análisis de series de tiempo tradicional. Por ello, la teoría y los métodos estadísticos desempeñan un papel importante en el análisis de las series de tiempo en finanzas. El objetivo de este trabajo es presentar las teorías básicas del análisis de series de tiempo, haciendo énfasis en los modelos que son de gran utilidad en el análisis de series de tiempo financieras. Se presentan aplicaciones de los modelos analizados.