

ÍNDICE

Introducción	13
Primera parte	
Mercados financieros	23
Factores macroeconómicos y riesgo sistemático en los mercados de capital del TLCAN <i>Christian Bucio y Edgar Ortiz.....</i>	25
Crisis del financiamiento en México. Papel de los mercados financieros † <i>Héctor Rogelio Nuñez Estrada</i>	53
Mediciones de capital económico como alternativas complementarias a la supervisión regulatoria de la banca <i>Gustavo Iván Fuertes Sánchez.....</i>	81
La red de seguridad bancaria en México: el caso del IPAB <i>Bernardo Quintanilla García</i>	113
Comportamiento de los fondos de pensión <i>Marissa R. Martínez Preece y Carlos Zubieta Badillo.....</i>	141

Segunda parte

Modelos financieros..... 165

- Análisis de riesgo sobre flujos de ingreso en ambiente semi-Markov mediante métodos de Monte Carlo
Luis Fernando Hoyos Reyes, Jesús I. González y Francisco Venegas-Martínez..... 167
- La inferencia bayesiana en la administración de riesgos
Carlos Vladimir Rodríguez Caballero 181
- Análisis de no linealidad en los rendimientos del Índice de Precios y Cotizaciones
José Israel Villagómez Bahena y Francisco Venegas-Martínez..... 217
- Reversión a la media en las tasas de acarreo de contratos futuros sobre productos agrícolas: el caso del maíz
Igor Patricio Rivera González y Andoni Gárritz-Cruz 239
- Evidencias de memoria larga en el Índice de Precios y Cotizaciones de la Bolsa Mexicana de Valores
Francisco López Herrera, José Israel Villagómez Bahena y Francisco Venegas-Martínez..... 257
- Los efectos “Día de la Semana” y “Mes del Año” para los rendimientos de una muestra de acciones que cotizan en la Bolsa Mexicana de Valores
Domingo Rodríguez Benavides y Arturo Morales Castro 281

Tercera parte

Entorno económico..... 299

- Modelos estocásticos de equilibrio general que intervienen en el equilibrio macroeconómico y su repercusión en las finanzas
Raúl Camacho Erazo y Francisco Venegas-Martínez..... 301
- Origen de la crisis financiera *subprime* y su impacto en la política monetaria
Pablo López Sarabia y Miguel Cervantes Jiménez 337

La incidencia de la política monetaria en México en un entorno de oligopolio bancario, una perspectiva de equilibrio dinámico con aversión al riesgo <i>Ulises Hernández Ramos</i>	367
Efectos del entorno económico sobre la calidad crediticia: dinámica de los <i>spreads</i> en México <i>Francisco López Herrera y César Gurrola Ríos</i>	387
La política fiscal y su relación con el desempeño de Pemex, 1980-2008 <i>Daniel Romo Rico, Nicolás Domínguez Vergara y Sergio Galina Hidalgo</i>	417
Migración y remesas: un análisis del Tratado de Libre Comercio de América del Norte a la crisis financiera <i>subprime</i> <i>Pablo López Sarabia y Miguel Cervantes Jiménez</i>	445
Sobre los autores.....	495