



UAEM | Universidad Autónoma
del Estado de México

SD
Secretaría de Docencia



Universidad Autónoma del Estado de México • Secretaría de Docencia • Dirección de Estudios Profesionales

Universidad Autónoma del Estado de México

Licenciatura en Física 2003

Programa de Estudios:

Econofísica



I. Datos de identificación

Licenciatura

Unidad de aprendizaje Clave

| | | | | |
|-----------------|--------------------------------|--------------------------------|--------------------------------|---------------------------------|
| Carga académica | <input type="text" value="4"/> | <input type="text" value="2"/> | <input type="text" value="6"/> | <input type="text" value="10"/> |
| | Horas teóricas | Horas prácticas | Total de horas | Créditos |

Período escolar en que se ubica

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|

| | | |
|-----------|---|--------------------------------------|
| Seriación | <input type="text" value="Física Estadística"/> | <input type="text" value="Ninguna"/> |
| | UA Antecedente | UA Consecuente |

Tipo de Unidad de Aprendizaje

| | | | |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|-------------------------------------|
| Curso | <input type="checkbox"/> | Curso taller | <input checked="" type="checkbox"/> |
| Seminario | <input type="checkbox"/> | Taller | <input type="checkbox"/> |
| Laboratorio | <input type="checkbox"/> | Práctica profesional | <input type="checkbox"/> |
| Otro tipo (especificar) | <input type="text"/> | | |

Modalidad educativa

| | | | |
|----------------------------------|-------------------------------------|--------------------------------------|--------------------------|
| Escolarizada. Sistema rígido | <input type="checkbox"/> | No escolarizada. Sistema virtual | <input type="checkbox"/> |
| Escolarizada. Sistema flexible | <input checked="" type="checkbox"/> | No escolarizada. Sistema a distancia | <input type="checkbox"/> |
| No escolarizada. Sistema abierto | <input type="checkbox"/> | Mixta (especificar) | <input type="text"/> |

Formación común

| | | | |
|------------------|--------------------------|---------------|--------------------------|
| Biología 2003 | <input type="checkbox"/> | Biología 2010 | <input type="checkbox"/> |
| Matemáticas 2003 | <input type="checkbox"/> | | |

Formación equivalente

Unidad de Aprendizaje

| | |
|------------------|----------------------|
| Biología 2003 | <input type="text"/> |
| Biología 2010 | <input type="text"/> |
| Matemáticas 2003 | <input type="text"/> |



II. Presentación

Los físicos han contribuido a modelar lo que hoy en día se conoce como sistemas complejos. Las herramientas y metodología utilizada comprenden aspectos de física estadística y física teórica. La incursión de la física en las Ciencias Sociales data de 1738 cuando Daniel Bernoulli sugirió la conveniencia de modelar las preferencias de un conjunto de individuos. Posteriormente en 1812 cuando Pierre-Simon Laplace, apuntó que aun cuando algunos eventos parecerían azarosos e impredecibles; como el número de cartas que terminaban en la oficina de cartas no-entregadas en el Palacio Postal de París, dicho número no sólo era predecible sino que podía ser modelado con una ley simple. En el siglo XIX analogías con teorías de la física jugaron un papel relevante en el desarrollo de teorías económicas, por mencionar un ejemplo está el caso de Irwin Fisher quien fue fundador de la teoría de la economía neoclásica, Fisher inició con una formación de físico siendo alumno de J. Willard Gibbs. Sin embargo en 1938 Ettore Majorana, recopiló e hizo notar, atinadamente, los aciertos y problemas de aplicar métodos de la física estadística a las ciencias sociales.

El término econofísica fue acuñado a mediados de los 90's por Eugene Stanley, es un campo interdisciplinario que comprende el aplicar metodologías relacionadas con procesos estocásticos y dinámica no lineal al comportamiento del mercado cambiario. Sin embargo también existen herramientas de otros campos como la dinámica de fluidos, mecánica cuántica y la teoría de integrales de trayectoria que buscan ser incorporados a esta nueva visión de modelos económicos.

En particular, en las últimas décadas se han suscitado cambios relevantes en el mundo de las finanzas. El año de 1973 es clave porque las monedas figuraron en el mercado cambiario y sus valores fueron determinados por el mercado internacional, dicho mercado está activo las 24 horas del día. Desde 1980 se inició el proceso de compra-venta vía electrónica y este proceso también fue incorporado al mercado cambiario internacional, esto implicó el almacenamiento de información electrónica relacionada con el mercado cambiario a la par que los intercambios electrónicos internacionales, y así , hoy en día se puede contar con acceso a una gran cantidad de información financiera. La econofísica se basa en considerar que en la economía hay fenómenos econométricos que son procesos macroscópicos susceptibles a mediciones, adicionalmente son el resultado de la interacción "microscópica" entre muchos agentes, de aquí que presenta una gran similitud con los fenómenos estudiados por la física de sistemas complejos. De hecho algunas universidades de países pertenecientes a la Comunidad Económica Europea sugieren esta disciplina como herramienta básica y necesaria en los primeros semestres de posgrado.

Se pretende inculcar en el discente una visión más amplia de su formación en



física, una visión interdisciplinaria hacia las ciencias sociales. Que reconozca que debido a la aplicación de la física en campos relacionados con la organización y función de la economía, han surgido nuevos modelos en econometría y esto amplía su alcance como físico(a).

III. Ubicación de la unidad de aprendizaje en el mapa curricular

Núcleo de formación: Integral

Área Curricular: Interdisciplinarias y Complementarias

Carácter de la UA: Optativa

IV. Objetivos de la formación profesional.

Objetivos del programa educativo:

Formar especialistas con conocimientos de la Física teórica, experimental y computacional que les permitan participar en la generación, aplicación y difusión de los mismos, colaborando en la solución de problemas de índole social y natural que requieran del conocimiento científico.

Objetivos del núcleo de formación:

Proporcionar una visión integradora de carácter interdisciplinario, multidisciplinario y transdisciplinario para adquirir conocimientos específicos de su interés en los diversos escenarios donde tiene lugar la profesión del Físico.

Objetivos del área curricular o disciplinaria:

Fomentar una formación académica integral y complementaria a la disciplina.

V. Objetivos de la unidad de aprendizaje.

El discente se iniciará en el campo multidisciplinario de la econofísica y será capaz de aplicar y adaptar la física estadística, la teoría de dinámica lineal y no lineal para analizar y resolver problemas propios del mercado financiero.



VI. Contenidos de la unidad de aprendizaje y su organización

Unidad 1. Elementos básicos de la eficiencia de mercados financieros.

- 1.1 Conceptos, paradigmas y variables
- 1.2 Hipótesis del Mercado eficiente.
- 1.3 La Teoría de algoritmos de complejidad.
- 1.4 Información propia de series de tiempo financieras.
- 1.5 Sistemas ideales en física y finanzas.

Unidad 2. Caminatas aleatorias, procesos estocásticos de Lévy y teoremas límites

Objetivo: Será capaz de manejar los conceptos básicos de procesos estocásticos.

- 2.1 Conceptos básicos de procesos estocásticos:
- 2.2 Caminante al azar
- 2.3 Vuelos de Lévy.
- 2.4 Distribuciones de probabilidad asociadas a leyes de potencia.
- 2.5 Límites

Unidad 3. Análisis de escalas en datos financieros

- 3.1 Escalas de precios en mercados financieros.
- 3.2 Escalas de tiempo en mercados financieros.

Unidad 4. Modelos estocásticos para la dinámica de precios

Objetivo: Identificación de modelos estocásticos asociados a la dinámica de precios

- 4.1 Modelo de Lévy estable y no-gaussiano
- 4.2 Distribución “t” de Student.
- 4.3 Combinación de distribuciones Gaussianas.
- 4.4 Vuelos de Lévy truncados.

Unidad 5. Procesos estocásticos estacionarios y correlaciones temporales de series de tiempo financieras.



5.1 Correlaciones temporales y el caso estacionario de procesos estocásticos.

5.2 Procesos estocásticos de corto y largo alcance.

5.3 Funciones de autocorrelación y densidad espectral de series de tiempo relacionados con cambios en precios.

5.4 Caso estacionario

Unidad 6. Mercados financieros: escalamientos, decaimientos y turbulencia

6.1 Análisis empíricos del índice Standard & Poor's 500.

6.2 Comparación con el caso de vuelos de Lévy truncados (TLF).

6.3 Analogía entre turbulencia en fluidos vs turbulencia en la dinámica de precios.

6.4 Leyes de potencia en turbulencia en mercados financieros.

Unidad 7. Correlaciones y anticorrelaciones entre acciones mercantiles

7.1 Dinámica simultánea entre acciones acopladas.

7.2 Propiedades estadísticas y matrices de correlación.

7.3 Taxonomía de un portafolio de acciones

Unidad 8. Aplicaciones

8.1 Alternativas en mercados ideales:

Introducción a la teoría de riesgos, especulación y encubrimiento

La fórmula Black & Scholes

8.2 Alternativas en mercados reales:

Manejo discontinuo de acciones

Volatilidad de mercados

Encubrimiento en mercados reales

Modelo generalizado de Black & Scholes



VII. Sistema de Evaluación

1. Ejercicios individuales: 50%
2. Tareas y exposiciones: 25%
3. Participación activa en clase: 25%

VIII. Acervo Bibliográfico

An Introduction to Econophysics Correlations and Complexity in Finance, R.N. Mantegna y H.E. Stanley, Cambridge University Press, Cambridge, (2000)

Econophysics and Sociophysics, Trends and Perspectives, Eds. B. Chakrabarti, K. Chakraborti, A. Chatterjee

Wiley-VCH, Berlin, (2006).

Theory of Financial Risk: From Statistical Physics to Risk Management, Cambridge University Press, Cambridge (2000).

Dynamics of Markets: Econophysics and Finance, J. L. McCauley, Cambridge University Press, Cambridge (2004).

Foro de Econofísica radicado en la página <http://www.unifr.ch/econophysics/>

J. D. Farmer, M. Shubik y E. Smith, Physics Today Septiembre (2005) 37.

“Econophysics Matter” Editorial de Nature, 441 (2006)667.

New Directions in Statistical Physics : Econophysics, Bioinformatics, and Pattern Recognition, Luc T. Wille (Ed.) Springer, (2004)