

“El Modelo ampliado de Fama y French en el contexto del Mercado Mexicano de capitales durante el periodo 2010-2022: una prueba empírica”

I. Participantes

Responsable del proyecto: Mtro. Lorenzo Arellano Paredes, Profesor Asociado, Departamento de Estudios Institucionales, DCSH. Móvil: 5554777291, e-mail: larellanop@cua.uam.mx.

Colaboradores: Alumnas(os) de Servicio social de la Lic. en Administración. Se requerirán 2 Alumnos(as) para dic 2021-mayo 2022 y otros 2 Alumnas(os) para junio-nov 2022. Actualmente ya se tienen 3 Alumnos(as) contactados con interés para incorporarse al proyecto como prestadores de Servicio social.

II. Hipótesis de trabajo

Las hipótesis a probar en la investigación son las siguientes:

H1: Existe evidencia estadística significativa y robusta de que el modelo ampliado de cinco factores Fama y French (1993; 2015), es apropiado para explicar y predecir el rendimiento de las acciones de las empresas que cotizan en los mercados de valores de economías emergentes como México, en función de los factores elegidos por Fama y French (1993; 2015).

H1: No existe evidencia estadística significativa y robusta de que el modelo ampliado de cinco factores de Fama y French (1993; 2015), es apropiado para explicar y predecir el rendimiento de las acciones de las empresas que cotizan en los mercados de valores de economías emergentes como México, en función de los factores elegidos por Fama y French (1993). Por lo que en este caso, se requiere proponer y elegir otros factores domésticos dentro del modelo de Fama y French (1993; 2015) para el caso de economías emergentes como México.

III. Objetivo

Desarrollar un modelo econométrico para probar el modelo ampliado de cinco factores de Fama y French (1993; 2015) con datos semanales o mensuales del mercado accionario mexicano durante el periodo 2010-2022, y determinar si los factores del modelo son apropiados y válidos para explicar y predecir el rendimiento de las acciones de las empresas que cotizan en la Bolsa Mexicana de Valores. Y en caso contrario, proponer otros factores domésticos dentro del modelo a efecto de que pueda explicar y predecir mejor el rendimiento de las acciones en el Mercado Mexicano de valores.

IV. Duración: 1 de Dic 2021 a 30 de Nov 2022.