

Nombre

Dra. Magnolia Miriam Sosa Castro

Programa

Maestría

Campo disciplinario

Optimación Financiera

Semblanza

Es Doctora en Economía, Maestra en Ingeniería y Licenciada en Economía por la Universidad Nacional Autónoma de México. Se ha desempeñado como investigadora, analista y académica en varias universidades. Ha publicado 53 productos de investigación en revistas y libros especializados nacionales e internacionales. Ha presentado más de 110 ponencias en diferentes eventos académicos especializados a nivel nacional e internacional. Ha participado como árbitro en revistas académicas especializadas y como dictaminador en eventos académicos. Es miembro numerario de la Academia de Ciencias Administrativas y miembro del Sistema Nacional de Investigadores, Nivel I y cuenta con el reconocimiento al Perfil Deseable para Profesor de Tiempo Completo (PROMEP).

Contacto

Correo

msosac87@hotmail.com



Líneas de investigación

- Crisis económicas y financieras
- Análisis y administración de riesgos
- Mercados de dinero y capital
- Productos financieros derivados
- Ingeniería y gestión financiera
- Econometría financiera y modelos de política cambiaria.

Profesor de las asignaturas

- √ Gestión Financiera
- √ Ingeniería Financiera
- √ Proyecto de Investigación

Tesis recientes

1. “Propuesta de creación de ETFs sectoriales en México y construcción de carteras eficientes a partir de los mismos” José Roberto Torres Bello. Maestría en Optimización Financiera. Posgrado de Ingeniería. UNAM. 9 de agosto, 2019. *Mención honorífica.*
<http://132.248.9.195/ptd2019/junio/0790327/Index.html>
2. “Desarrollo de un modelo de credit scoring para un portafolio de tarjetas de crédito” Marco Antonio Reyes Morales. Maestría en Optimización Financiera. Posgrado de Ingeniería. UNAM. 7 de enero 2021.
<http://132.248.9.195/ptd2020/octubre/0804746/Index.html>
3. “Crisis financiera global; contagio financiero por la vía bursátil a nivel sectorial entre México y Estados Unidos”. Aaron Brito Rabadán. Programa de Posgrado de Economía. IIEc. UNAM. 16 de abril 2021. *Mención honorífica.* <http://132.248.9.195/ptd2020/noviembre/0805433/Index.html>
4. “Sistema de contribución y atribución de rendimientos en carteras de inversión de deuda y renta variable aplicando la metodología internacional GIPS”. González Balderas José Antonio. 21 abril 2022. Posgrado de Ingeniería. UNAM.
<http://132.248.9.195/ptd2022/enero/0821727/Index.html>
5. “Proyecto "distribuidor Guayabal km 2-500, tramo Villahermosa-Teapa" y su validación mediante una opción real de diferimiento”. Orihuela Butanda Juan Daniel. 3 de mayo 2022
<http://132.248.9.195/ptd2022/marzo/0823181/Index.html>

Publicaciones recientes

Artículos en Revistas

- Sosa, C. M., Ortiz, C. E. y Cabello, R. A. (en prensa) “ESG Green Equity Finance Risk and Links in Mexico: Conditional Volatility and Markov Switching Vector Analyses”. Número Especial Current Issues on Globalization and Sustainable Development”. Revista Mexicana de Economía y Finanzas REMEF. Conacyt competencia internacional.
- Sosa, C. M., Ortiz, C. E. y Cabello, R. A. (2023) "COVID19 Outbreak Impact on International Stock Markets Volatility Contagion". Journal of Quantitative Methods for Economics and Business Administration. Vol. 35.
- Sosa C. M. (2022) Proyecto de inversión de mantenimiento, renovación y modernización del material rodante del Sistema de Transporte Colectivo (STC) Metro. Ingeniería Industrial. No. 42. Junio 2022. ISSN 2523-6326. Pp 203-228.
https://revistas.ulima.edu.pe/index.php/Ingenieria_industrial/article/view/5389/5649
- Sosa C. M. (2022) Equity Market Volatility impact on S&P 500 Sector Indexes, 1989-2021. *Applied Econometrics and International Development*.
https://ideas.repec.org/a/eea/aeinde/v22y2022i1_3.html
- Reyes, H. M. A. y Sosa, C. M. (2022). “Modelo de puntuación crediticia para tarjeta de crédito en México: una aproximación logística” *Ensayos Revista de Economía*. Vol. 41, No.1, 2022
- Ortiz, C. E., Sosa, C. M. y Cabello, R. A. (2022) “Riesgo e incertidumbre del peso mexicano a largo plazo- Testimonio sobre 14 sexenios-” Revista *Denarius*. Departamento de Economía y Administración. UAM-Iztapalapa. Número 42. (enero-junio 2022).
- Sosa, C. M., Ortiz, C. E. y Cabello, R. A. (2022) “US Equity Market Volatility Index Components, Impact on the Industrial Production Index and Post Covid-19 Forecasting: Relevance to Mexico”. Revista Contaduría y Administración. UNAM. Lecciones de la pandemia de Covid-19 (In Press). Vol. 66, No. 5
<http://www.cya.unam.mx/index.php/cya/article/download/3457/1657>
- Castro, O. J. y Sosa, C. M. (2022) “Determinantes de la jefatura femenina en los hogares mexicanos: aplicación de modelos Logit y Probit (2008-2018)”. Revista *Korpus* 21.
<http://korpus21.cmq.edu.mx/index.php/ohli/article/view/56/76>
- Sosa, C. M., Ortiz, C. E. y Cabello, R. A. (2022) “Financiación empresarial con cripto-tokens: Riesgos y valuación”. Revista de Economía Crítica. No. 32.
<http://www.revistaeconomicacritica.org/index.php/rec/article/view/575/550>
- Sosa C. M., Bucio, P. C. y Ortiz, C. E. (2022) “Dynamic Stock Dependence and Monetary Variables in the United States (2000-2016): A Copula and Neural Network Approach”. *Lecturas de Economía*.
<https://revistas.udea.edu.co/index.php/lecturasdeeconomia/article/view/345321/20806800>

- Cernichiaro, R. C., Sosa, C. M. y Ortiz, C. E. (2022) “Incidencia del gasto público y deuda subnacional en el crecimiento económico sectorial estatal en México (2010-2018)”. Revista Análisis Económico, UAM-Azcapotzalco.
<http://www.analisiseconomico.azc.uam.mx/index.php/rae/article/view/668>

Capítulos de libro:

- Sosa, M. & Ortiz, E., (2021). Crisis y volatilidad asimétrica en los mercados accionarios del MILA. Martínez Preece, M. Zubieta, C. Badillo y F. López Herrera (coords.), Administración de Riesgos, Volumen VIII. ISBN 978-607-28-2363-1
- Sosa, C. M., Ortiz, C. E. y Cabello R. A. (2021). “Estimación de la volatilidad cambiaria mexicana durante el régimen de metas de inflación”. En *Dos décadas de metas de inflación y apertura financiera en México*. Coord. Roberto Valencia. Facultad de Economía. UNAM.
- Díaz-Rodríguez, H., Sosa C. M & Cabello, R. A. (2021) “Impact of Digitalisation on Human Capital Skills and Talent Flows in the Financial Industry: A Graph Theory Approach” in *Digitalization and Firm Performance. Examining the Strategic Impact*, M. Ratajczak-Mrozek, P. Marszałek (eds.), Palgrave Macmillan, Forthcoming.

Distinciones.

- Miembro del Sistema Nacional de Investigadores, nivel I (2018-2020) y (2021-2024)
- Reconocimiento al Perfil Deseable para Profesor de Tiempo Completo (PROMEP) 2019-2024.
- Premio a la mejor ponencia del “Congreso Internacional de Economía Financiera y administración de Riesgos” por la American Academy of Financial Management a la ponencia “Impact of Leverage, Solvency and Size Effect on Mexican Capital Market Firms Returns” 2 de junio 2022.
- Premio Anual de Investigación Económica Maestro Jesús Silva Herzog 2020, resultando merecedor de mención honorífica del Premio en la Versión Mejor artículo publicado en la Revista Problemas del Desarrollo, por el artículo en coautoría titulado “Determinantes del endeudamiento de los hogares en México: un análisis con redes neuronales.” Junio, 2021.