

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO  
PLANO DE ENSINO

					ANO E SEMESTRE
					2020/2
<b>PROFESSOR(A)</b>					
AURELIANO ANGEL BRESSAN					
<b>DISCIPLINA NA MODALIDADE DE ENSINO REMOTO EMERGENCIAL (ERE)</b>					<b>CÓDIGO</b>
MÉTODOS ECONOMETRÍCOS EM FINANÇAS					CAD009
<b>CARGA HORÁRIA</b>	<b>CRÉDITOS</b>	<b>HORÁRIO</b>	<b>BIMESTRE</b>	<b>DIA DA SEMANA</b>	
30	2	14:00-18:00	2º	SEGUNDA-FEIRA	
<b>AUTORIZA A OFERTA DE MATRÍCULA NA MODALIDADE DISCIPLINA ISOLADA?</b>					
(X) Não ( ) Sim – Número de vagas: ____					
<b>AUTORIZA OFERTA DE MATRÍCULA DE GRADUANDO NA MODALIDADE DISCIPLINA ELETIVA?</b>					
(X) Não ( ) Sim – Número de vagas (até 2 vagas): ____					
<b>A DISCIPLINA É MINISTRADA EM IDIOMA ESTRANGEIRO?</b>					
(X) Não ( ) Sim Qual:					
<b>PROJETO(S) DE PESQUISA APROVADO(S) EM ÓRGÃO(S) DE FOMENTO QUE PODE(M) SER VINCULADO(S) À DISCIPLINA</b>					
N/A					
<b>AGÊNCIA(S) DE FOMENTO</b>					
N/A					
<b>NÚMERO DE PROTOCOLO DO REGISTRO/DA APROVAÇÃO NA PLATAFORMA BRASIL (se for o caso)</b>					
N/A					
<b>EMENTA</b>					
<p><b>Objetivo:</b> O curso tem por objetivo propiciar ao estudante o conhecimento dos principais métodos econométricos aplicados em Finanças, introduzindo alguns dos métodos mais frequentemente utilizados na literatura recente, com ênfase na aplicação de softwares que possibilitem a condução de estudos empíricos aplicados. <b>Ementa:</b> Para a consecução destes objetivos, o programa tem por base uma incursão pelos principais</p>					

métodos de estimação, a saber: o paradigma dos mínimos quadrados (mínimos quadrados ordinários e mínimos quadrados generalizados), e o método de máxima verossimilhança, analisando modelos básicos para dados em seção cruzada, séries temporais e painel. Para a assimilação destes métodos de estimação, será feito uso intensivo do pacote estatístico R.

**PROGRAMA (Especificar as atividades síncronas e assíncronas)**

Aula	Tópicos abordados	Formato
1	<i>Revisão de estatística usando o ambiente R.</i>	Síncrono
2	<i>Estimação por Mínimos Quadrados Ordinários: Intuição e Abordagem Matricial à Regressão. Regressão Simples e múltipla no R: estimação e análise.</i>	Assíncrono
3	<i>Modelos Restritos e Irrestritos; Teste F e Formas Funcionais e variáveis dummy.</i>	Assíncrono
4	<i>Estimação por Máxima Verossimilhança e testes relacionados (W, LM e LR). Tratamento das violações dos pressupostos: Heterocedasticidade, Autocorrelação, Multicolinearidade.</i>	Assíncrono
5	<i>Variáveis Instrumentais, Mínimos Quadrados de dois estágios e Método dos Momentos.</i>	Assíncrono
6	<i>Modelos para dados em Painel – Especificações e Testes Básicos.</i>	Assíncrono
7	<i>Experimentos e Quase-experimentos</i>	Assíncrono
8	Webinar: apresentação das propostas de trabalho.	Síncrono

**BIBLIOGRAFIA**

**Bibliografia Básica:**

HEIJ, C., DEBOER, P., FRANCES, P.H., KLOEK, T., VANDIJK, H.K. **Econometric Methods with Applications in Business and Economics**. Oxford: Oxford University Press, 2004.

HANCK, C., ARNOLD, M., GERBER, A., SCHMELZER, M. (2019). **Introduction to Econometrics with R**. Disponível em <https://www.econometrics-with-r.org/>

**Bibliografia Complementar:**

ALEXANDER, C. **Market Risk Analysis: Volume I - Quantitative Methods in Finance**. Chichester: Wiley, 2008.

ALEXANDER, C. **Market Risk Analysis: Volume II – Practical Financial Econometrics**. Chichester: Wiley, 2008.

BROOKS, C. **Introductory Econometrics for Finance**. Cambridge: Cambridge U. Press, 2008.

CAMERON, A. C., TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics**. Cambridge: Cambridge U. Press, 2005.

CAMERON, A. C., TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics Using Stata**. College Station: Statacorp, 2009.

GREENE, W. H. **Econometric Analysis**. (6 edição) Upper Saddle River: Prentice-Hall, 2008.

JOHNSTON, J. DINARDO, J. **Econometric Methods**. New York: McGraw-Hill, 1996.

KLEIBER, C., ZEILIS, A. **Applied Econometrics with R**. New York: Springer, 2008.

R Development Core Team (2010). **R: A language and environment for statistical computing**. R Foundation for Statistical Computing, Vienna, Austria. Disponível em: <http://www.R-project.org>.

**TEXTOS E DOCUMENTOS DISPONÍVEIS NA WEB**

Hanck, C., Arnold, M., Gerber, A., & Schmelzer, M. (2019). **Introduction to Econometrics with R**. Disponível em <https://www.econometrics-with-r.org/>

SISTEMA DE AVALIAÇÃO	
Atividade	Valor
Banco de dados (avaliado por pares)	5
Participação em fóruns	5
Atividade de Pesquisa Empírica ( <i>paper publicável</i> )	30
Avaliações online	30
Estudos de caso	18
Repositório de experiências	10
Autoavaliação e avaliação da disciplina	2
<b>Total</b>	<b>100</b>
INFORMAÇÕES ADICIONAIS	