

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO

PLANO DE ENSINO

ANO E SEMESTRE				
2021/2				
PROFESSOR(A)				
Aureliano Angel Bressan				
DISCIPLINA				CÓDIGO
Métodos Econométricos em Finanças				CAD009
CARGA HORÁRIA	CRÉDITOS	HORÁRIO	BIMESTRE	DIA DA SEMANA
30	02	14:00-17:45	1º	QUINTA-FEIRA
AUTORIZA A OFERTA DE MATRÍCULA NA MODALIDADE DISCIPLINA ISOLADA?				
<input checked="" type="checkbox"/> Não <input type="checkbox"/> Sim – Número de vagas: _____				
AUTORIZA OFERTA DE MATRÍCULA DE GRUANDO NA MODALIDADE DISCIPLINA ELETIVA?				
<input type="checkbox"/> Não <input checked="" type="checkbox"/> Sim – Número de vagas (até 2 vagas): _1_				
A DISCIPLINA É MINISTRADA EM IDIOMA ESTRANGEIRO?				
<input checked="" type="checkbox"/> Não <input type="checkbox"/> Sim Qual:				
PROJETO(S) DE PESQUISA APROVADO(S) EM ÓRGÃO(S) DE FOMENTO QUE PODE(M) SER VINCULADO(S) À DISCIPLINA				
N/A				
AGÊNCIA(S) DE FOMENTO				
N/A				
NÚMERO DE PROTOCOLO DO REGISTRO/DA APROVAÇÃO NA PLATAFORMA BRASIL (se for o caso)				
N/A				
EMENTA				
<p>Objetivo: 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. Ementa: Para a consecução destes objetivos, o programa tem por base uma incursão pelos principais 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.</p>				

PROGRAMA		
Aula	Tópicos abordados	Formato
1	Revisão de estatística usando o ambiente R.	Síncrono
2	Estimação por Mínimos Quadrados Ordinários: Intuição e Abordagem Matricial à Regressão. Regressão Simples e múltipla no R: estimação e análise.	Síncrono
3	Modelos Restritos e Irrestritos; Teste F e Formas Funcionais e variáveis dummy.	Síncrono
4	Estimação por Máxima Verossimilhança e testes relacionados (W, LM e LR). Tratamento das violações dos pressupostos: Heterocedasticidade, Autocorrelação, Multicolinearidade.	Síncrono
5	Variáveis Instrumentais, Mínimos Quadrados de dois estágios e Método dos Momentos.	Síncrono
6	Modelos para dados em Painel – Especificações e Testes Básicos.	Síncrono
7	Experimentos e Quase-experimentos	Síncrono
8	Webinar: apresentação das propostas de trabalho.	Síncrono
BIBLIOGRAFIA		
<p>Bibliografia Básica: HEIJ, C., DEBOER, P., FRANSES, 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/ PERLIN, Marcelo S. Processing and Analyzing Financial Data with R. 2017. Disponível em: https://www.msperlin.com/pafdR/.</p> <p>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.</p>		
TEXTOS E DOCUMENTOS DISPONÍVEIS NA WEB		
<p>HANCK, C., ARNOLD, M., GERBER, A., SCHMELZER, M. (2019). Introduction to Econometrics with R. Disponível em https://www.econometrics-with-r.org/ PERLIN, Marcelo S. Processing and Analyzing Financial Data with R. 2017. Disponível em: https://www.msperlin.com/pafdR/.</p>		
SISTEMA DE AVALIAÇÃO		
Atividade		Valor
Banco de dados		15
Participação em aulas		15

Atividade de Pesquisa Empírica (<i>paper publicável</i>)	35
Seminários	35
Total	100
INFORMAÇÕES ADICIONAIS	