

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO
PLANO DE ENSINO

					ANO E SEMESTRE
					2022/2
PROFESSOR(A)					
AURELIANO ANGEL BRESSAN					
DISCIPLINA NA MODALIDADE DE ENSINO REMOTO EMERGENCIAL (ERE)					CÓDIGO
MÉTODOS ECONÔMICOS EM FINANÇAS					CAD009
CARGA HORÁRIA	CRÉDITOS	HORÁRIO	BIMESTRE	DIA DA SEMANA	
30	2	13:30-17:00	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 GRADUANDO 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</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	Revisão de estatística usando o ambiente R.	Presencial
2	Estimação por Mínimos Quadrados Ordinários: Intuição e Abordagem Matricial à Regressão. Regressão Simples e múltipla no R: estimação e análise.	Presencial
3	Modelos Restritos e Irrestritos; Teste F e Formas Funcionais e variáveis dummy.	Presencial
4	Estimação por Máxima Verossimilhança e testes relacionados (W, LM e LR). Tratamento das violações dos pressupostos: Heterocedasticidade, Autocorrelação, Multicolinearidade.	Presencial
5	Variáveis Instrumentais, Mínimos Quadrados de dois estágios e Método dos Momentos.	Presencial
6	Modelos para dados em Painel – Especificações e Testes Básicos.	Presencial
7	Experimentos e Quase-experimentos	Presencial
8	Avaliação Final	Presencial

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
Atividade de Pesquisa Empírica (<i>paper publicável</i>)	30
Atividades em sala	30
Prova Final	30
Autoavaliação e avaliação da disciplina	10
Total	100
INFORMAÇÕES ADICIONAIS	