



FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

| | | |
|---|---|------------------------|
| CÓDIGO: _____ | COMPONENTE CURRICULAR: Informações e Negócios | |
| UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE: FACULDADE DE GESTÃO E NEGÓCIOS | SIGLA: FAGEN | |
| CH TOTAL TEÓRICA: 30 | CH TOTAL PRÁTICA: 30 | CH TOTAL: 60 |

OBJETIVOS

Apronfundar o conhecimento sobre modelos de regressão, conhecendo seus conceitos básicos, fundamentos e limitações. Avançar no conhecimento dos pressupostos econometricos aplicados. Aplicar os conceitos em situações específicas das áreas da Administração de Empresas.

EMENTA

Fundamentos da Análise de Regressão Múltipla, Relaxamento das hipóteses do modelo clássico, Variáveis dummy, Regressão com dados em painel, Tópicos Adicionais e aplicação dos conceitos na administração de empresas.

PROGRAMA

- 1. Fundamentos da Análise de Regressão Múltipla**
 - a. As hipóteses do Modelo de Mínimos Quadrados Clássico
 - b. Propriedades assintóticas
 - c. Viés e não viés dos estimadores
 - d. Eficiência dos Estimadores
- 2. Relaxamento das Hipóteses do Modelo Clássico**
 - a. Regressores errados, não linearidade e inconstância de parâmetro
 - b. Distúrbio esperado diferente de zero
 - c. Heteroscedasticidade e Homocedasticidade
 - d. Autocorrelação dos erros
 - e. Multicolinearidade
- 3. Variáveis Dummy**
 - a. Criação e utilização de variáveis dummy
 - b. Interpretação das variáveis dummy

- c. Variáveis dummy específicas por observação
- d. Os efeitos da Interação

4. Regressão com Dados em Paineis

- a. Estrutura de dados em painéis
- b. Preparação de dados em painéis para regressão de dados agrupados (POLS)
- c. Dados em painéis com dois períodos de tempo: Comparação de antes e depois
- d. Regressão com Efeitos Fixos
- e. Regressão com Efeitos Aleatórios
- f. Teste de Hausman

5. Tópicos Adicionais

- a. Simulação de Monte Carlo
- b. Tratamento de outliers e winsorização
- c. Tratamento de missing values

6. Análise de Dados aplicada a casos de Administração

- a. Desenvolvimento e aplicação dos conceitos em Marketing
- b. Desenvolvimento e aplicação dos conceitos em Finanças
- c. Desenvolvimento e aplicação dos conceitos em Recursos Humanos e Organizações
- d. Desenvolvimento e aplicação dos conceitos em Produção, Operações e Gestão de Projetos

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

HAIR Jr, J. F.; BABIN, B.; MONEY, A. H.; SEMOUEL, P. **Fundamentos de métodos de pesquisa em Administração**. Porto Alegre: Bookman, 2005. 471 p.

STOCK, J. H., WATSON, M. W. **Econometria**. São Paulo: Addison Wesley, 2004.

KENNEDY, P. **Manual de Econometria**. 6. Ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2009.

GUJARATI, D. N., PORTER, D. C. **Econometria Básica**. 5. Ed. Porto Alegre: Bookman, 2011.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

HAIR JR., J. F. BLACK, W. C., BABIN, B. J., ANDERSON, R. E., TATHAN, R. L.. **Análise Multivariada de Dados**. 6. ed. Porto Alegre: Bookman, 2009.

SILVA, F. L.; FAVERO, L. P.; BELFIORE, P.; CHAN, B. **Análise de Dados – Modelagem multivariada para tomada de decisões**. Rio de Janeiro: Campus, 2009.

ANDERSON, T. W. **An introduction to multivariate statistical analysis**. 3 ed. Hoboken, N.J. : Wiley-Interscience, 2003.

CARVALHO, Helena. **Análise Multivariada de Dados Qualitativos**. Rio de Janeiro: Silabo, 2004.

LATTIN, J.; CARROLL, J. D.; GREEN, P. E. **Análise de Dados Multivariados**. São Paulo: Cengage Learning,

FL. N.º 63
Secretaria-geral

2011

PAULO, E.; CORRAR, L. J.; DIAS FILHO, J. M. **Análise Multivariada para Administração, Ciências Contábeis e Economia.** São Paulo: Atlas, 2007.

STEVENS, J. **Applied Multivariate Statistics for the Social Sciences.** Hillsdale, NJ: Lawrence Erlbaum, 1992.

ZAMBALDI, F. **Análise Fatorial em Administração.** São Paulo: Cengage, 2009.

APROVAÇÃO

_____/_____/_____
UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
~~Prof. Dr. João Bento de Oliveira Filho~~
Coordenador do Curso de Administração da Faculdade de
Carimbo e Assinatura do Coordenador do Curso

03/10/2011
UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
Prof. Walter Gomes da Cunha
Diretor "pro-tempore" da Faculdade de Gestão e Negócios - FAGEN,
Carimbo e Assinatura do Diretor da
Unidade Acadêmica
(que oferece a disciplina)

FAGEN/UFU
Fl. N.º 334
VISTO