



UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA



## FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

<b>CÓDIGO:</b>	<b>COMPONENTE CURRICULAR:</b> Métodos Quantitativos Aplicados à Finanças	
<b>UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE:</b> <b>FACULDADE DE GESTÃO E NEGÓCIOS</b>	<b>SIGLA:</b> FAGEN	
<b>CH TOTAL TEÓRICA:</b> 30	<b>CH TOTAL PRÁTICA:</b> 30	<b>CH TOTAL:</b> 60

### OBJETIVOS

Dar ao aluno a compreensão de por que a econometria é necessária, e propiciar a habilidade de trabalhar com ferramentas básicas da econometria, tais como: (i) aplicar ferramentas a estimação, inferência e previsão no contexto de problemas econômicos do mundo real; (ii) compreender como processar informação proveniente de uma amostra de dados econômicos; (iii) ler e criticar os resultados de outras pessoas que usam ferramentas econométricas básicas; (iv) adquirir os fundamentos e compreensão para estudos posteriores de econometria; (v) avaliar a amplitude de técnicas mais avançadas que existem e que podem ser estudadas em cursos posteriores.

### EMENTA

- I – Análise de Dados em Painel
- II – Gerenciamento de Dados no Stata
- III – Métodos de Dados em Painel
- IV – Problemas de Análise de dados em Finanças
- V – Estudos empíricos em Finanças

### PROGRAMA

- I – Análise de Dados em Painel
  - Conceitos e utilidade de análise de dados em painel
  - Fontes de dados para utilização em análise de dados em painel
  - Preparação de base de dados para utilização em painel
  - O problema das variáveis omitidas



II – Gerenciamento de Dados no Stata

- Utilização de Base de dados em Painel no Stata
- Estatística Descritiva de Dados em Painel
- Preparação de Base de dados em Painel no Stata

III – Métodos de Dados em Painel

- Fixed Effects Model
- Random Effects Model
- Tratamento de erros: Cluster e Robust
- Teste de Hausman
- Análise de auto-correlação de dados em painel
- Utilização dos comandos do Stata: xtset, xtreg, hausman e parâmetros.

IV – Problemas de Análise de dados em Finanças

- O problema da Endogeneidade das variáveis
- Cuidados com inferências de relação causal entre variáveis

V – Estudos empíricos em Finanças

- Análise de artigos com utilização de dados em painel
- Replicação de artigos e interpretação dos resultados

**BIBLIOGRAFIA BÁSICA**

WOOLDRIDGE, J. M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2010.

GUJARATI, D. N. Econometria Básica. Rio de Janeiro: Campus, 2006.

JOHNSTON, J.; DINARDO, J. Métodos econométricos. 4ª ed. Lisboa: McGraw Hill, 2001. 573 p.

**BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR**

STOCK, J. H. e WATSON, M. W. Econometria. São Paulo: Pearson Education, 2004.

PINDYCK, R.; RUBINFELD, D. Econometria: modelos e previsões. 4ª Ed, Rio de Janeiro: Campus, 2004.

MADDALA, G. S. Introdução a Econometria. 3ª Ed, Rio de Janeiro: LTC Editora S.A, 2003.

HAIR, J. F.; ANDERSON, R. E.; TATHAM, R. L.; BLACK, W. C. Análise Multivariada de Dados. 5ª Ed, Porto Alegre: Bookman, 2005.

CAMERON, A. Colin; TRIVEDI, Pravin K. Microeconometrics Using Stata, Revised Edition. 2ª. Ed. Stata Press 2010



APROVAÇÃO

26, 09, 11

Universidade Federal de Uberlândia  
Prof. Dr. João Bento de Oliveira Filho  
Coordenador do Curso de Administração  
Faculdade de Gestão e Negócios  
Carimbo e assinatura do Coordenador do Curso  
Portaria R. nº. 636/2009

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)

