

Programa da disciplina

1. Introdução
 1. Introdução; Visão geral da disciplina
 2. Tipos de dados e regressões
 3. Estacionariedade
 4. Características das variáveis em finanças e contabilidade
 5. Retornos: discretos x contínuos; Preços/variáveis contábeis/lucros x retornos
 6. Modelagem econométrica
2. Regressão Simples
 1. Definições: regressão, variáveis dependentes e independentes, regressão x correlação, população x amostra
 2. Regressão simples e Mínimos quadrados
 3. Linearidade
 4. Premissas do modelo de regressão linear
 5. Propriedades do estimador de mínimos quadrados: estimadores não-viesados, consistentes, eficientes
 6. Erros padrões
 7. Variância dos erros
 8. Inferência estatística
 9. Testes de hipótese
 10. Intervalo de confiança
 11. Erros Tipo I e II
3. Matrizes
 1. Definições: matriz, matriz retangular, matriz quadrada, matriz nula, matriz diagonal, matriz identidade, escalar.
 2. Operações: soma, subtração, multiplicação, transposição, inversão, propriedades, derivação, autovalores, traço.
4. Regressão Múltipla
 1. Erros padrões na regressão múltipla
 2. O teste F
 3. Derivação do estimador de MQ em forma matricial
 4. Derivação do erro padrão
 5. Qualidade do ajuste: o coeficiente de determinação R^2 e R^2 ajustado
 6. Violação das premissas do modelo linear
 7. Heteroscedasticidade
 8. Teste de heteroscedasticidade (White)
 9. Autocorrelação
 10. Teste de autocorrelação (Durbin-Watson)
 11. Multicolinearidade
 12. Micronumerosidade
 13. Normalidade
 14. Teste de normalidade (Bera-Jarque)
 15. Valores extremos
 16. Variáveis latentes
5. Modelos Multivariados
 1. Modelos de equações simultâneas (estruturais)
 2. Viés de equações simultâneas
 3. Identificação
 4. Mínimos quadrados em 2 estágios
 5. Modelos VAR – vetores autoregressivos
 6. Teste de causalidade Granger
6. Processos Autoregressivos, Raízes Unitárias e Estacionariedade
 1. Estacionariedade
 2. Ruído branco
 3. Processos autoregressivos
 4. Critérios informacionais
 5. Regressões espúrias
 6. Tipos de não-estacionariedade
 7. Definição de não-estacionariedade
 8. Testes de raiz unitária (ADF)
 9. Cointegração e Modelo de correção de erro
 10. Teste de cointegração (Engle-Granger)
7. Dados em painel
 1. Pooled Regression
 2. Painel com efeitos fixos
 3. Painel com efeitos aleatórios
 4. Teste de Hausman

Avaliação: 3 provas e 1 trabalho final.

Bibliografia básica:

5. Brooks, C. Introductory Econometric for Finance. Cambridge University Press, 2nd ed, 2008.*
6. Heij, C. et al. Econometric Methods with Applications in Business and Economics. Oxford University Press, 2004.*
7. Gujarati, D. N. (2005). Basic Econometrics, New Delhi: Tata McGraw-Hill*.

Bibliografia complementar:

1. Canongia, M.A.G.; Coutinho e Silva, A.H. Análise do Impacto no Mercado de Capitais Devido à Adoção de Hedge Accounting por Empresas Brasileiras. Pensar Contábil, Rio de Janeiro, v. 16, n. 61, p. 4- 17, set./dez. 2014. *
2. Barbosa, G.C.; De Medeiros, O.R. Teste empírico da eficiência do mercado brasileiro na ocorrência de eventos favoráveis e desfavoráveis. Revista de Negócios, Blumenau, v. 12, n. 4, p. 44 - 54, outubro/dezembro 2007. *
3. Ball, R. & Brown, P. An empirical evaluation of accounting income numbers. Journal of Accounting Research, Vol. 6, Issue 2, Autumn 1968. *
4. Kothari, S.P. Capital markets research in accounting. Journal of Accounting and Economics, Volume 31, Issues 1-3, September 2001, Pages 105-231.
5. Iquiapaza, R. A.; Amaral, H. F.; Bressan, A. A. Evolução da pesquisa em finanças: epistemologia, paradigma e críticas. Organizações & Sociedade, v. 16, n. 49, art. 8, p. 351-370, 2009. *

- Disponível no site: <https://sites.google.com/site/otaviomedeiros2009/home/advanced-quantitative-methods>