

UNIVERSIDADE DE BRASÍLIA (UnB)
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM CONTABILIDADE

Prof. Herbert Kimura

1^osem/2020

Métodos Quantitativos Aplicados

Ementa:

Revisão de métodos quantitativos. Conceitos de probabilidade. Inferência estatística. Testes de hipótese. Análise de regressão. Estatística multivariada. Séries temporais. Ferramentas computacionais.

Objetivo:

Apresentar os principais conceitos necessários para análise quantitativa de dados, com ênfase em probabilidade e estatística.

Metodologia:

Aulas expositivas, discussão de casos em classe. Estudos e exercícios.

Avaliação:

- Trabalho de curso: Nota 0 a 10, Peso 30%
- Prova final: Nota 0 a 10, Peso 30%
- Exercícios e apresentações: Nota 0 a 10, Peso 20%
- Estudos dirigidos: Nota 0 a 10, Peso 20%

Os estudos dirigidos correspondem a trabalhos, pesquisas e atividades a serem resolvidos em casa, manualmente ou utilizando o computador. Os exercícios incluem resolução de problemas e apresentações de resultados de análise. Em algumas aulas, os alunos deverão fazer apresentações sobre aplicações específicas de técnicas quantitativas.

Cronograma de atividades:

O cronograma de atividades seguirá o calendário escolar, havendo flexibilidade de ajustes em função de eventos acadêmicos.

Conteúdo programático:

- Revisão de métodos quantitativos
- Noções de probabilidade
- Variáveis aleatórias
- Parâmetros estatísticos
- Probabilidade condicional
- Inferência estatística
- Teste de hipótese
- Modelos de regressão
- Noções de estatística multivariada
- Noções de séries temporais
- Novas abordagens quantitativas

Bibliografia:

- Principal
 - Hair Jr, J. F.; Black, W. C.; Babin, B. J.; Anderson, R. E. *Multivariate Data Analysis*, 7th edition. Pearson, 2009.
 - Wooldridge, J. M. *Introductory Econometrics*. 4a ed. Cengage Learning, 2009.
 - Johnson, R. A.; Wichern, D. W. *Applied Multivariate Statistical Analysis*. 6th edition. Phi Learning Private, 2012.
- Auxiliar
 - Ross, S. *A First Course in Probability*. 10th edition. Pearson, 2018.
 - Hardle, W. K.; Simar, L. *Applied Multivariate Statistical Analysis*. 4th edition. Springer, 2015.
 - Tsay, R. S. *Analysis of Financial Time Series*, 3rd Edition. Wiley, 2010.