

 <p>Universidade Federal de São João del-Rei</p>	<p>UNIVERSIDADE FEDERAL DE SÃO JOÃO DEL-REI – UFSJ Instituída pela Lei no 10.425, de 19/04/2002 – D.O.U. DE 22/04/2002 PRÓ-REITORIA DE ENSINO DE GRADUAÇÃO – PROEN COORDENADORIA DE CIÊNCIAS CONTÁBEIS – COCIC</p>	
CURSO: CIÊNCIAS CONTÁBEIS		
GRAU ACADÊMICO: Bacharelado	TURNO: Noturno	CURRÍCULO: 2022
UNIDADE CURRICULAR: MÉTODOS QUANTITATIVOS		
NATUREZA: OBRIGATÓRIA	UNIDADE ACADÊMICA: DEMAT	PERÍODO: 4º NOTURNO
PROFESSORA RESPONSÁVEL: LAÍS MESQUITA SILVA		C. H: 72 h/a PRÉ-REQUISITO: ESTATÍSTICA II SEMESTRE/ANO: 2º Semestre/2022
<p>EMENTA: Regressão linear simples e correlação simples. Pressupostos básicos do modelo clássico de regressão linear. Modelos não lineares. Estimacão e predicão dos estimadores. Regressão e correlacão múltiplas. Teste de hipóteses e predicão. Regressão pela origem. Violaçoes dos pressupostos básicos (causas, consequências, detecção e correções). Uso de variáveis binárias (dummy) no modelo de regressão. Modelos com variáveis defasadas. Introduçao à análise de séries temporais.</p>		
<p>OBJETIVOS: Apresentar aos alunos as modernas técnicas econométricas para desenvolvimento de pesquisas empíricas; para análise de dados contábeis, econômicos e financeiros; e para a tomada de decisões a partir de modelagem econométrica.</p>		
<p>CONTEÚDO:</p> <p>1. Regressão</p> <p>1.1. Diagrama de dispersão bidimensional e correlacão</p> <p>1.2. Regressão linear simples</p> <p>1.2.1. Estimacão e teste de hipóteses</p> <p>1.2.2. Pressupostos e Diagnóstico</p> <p>1.3. Regressão linear múltipla</p> <p>1.3.1. Estimacão e teste de hipóteses</p> <p>1.3.2. Pressupostos e Diagnóstico</p> <p>1.3.3. Modelos com interaçao</p> <p>1.3.4. Modelos com variáveis independentes dummy</p> <p>2. Modelos lineares generalizados (MLG)</p> <p>2.1. MLG de Poisson</p> <p>2.2. MLG Binomial Negativo</p> <p>2.3. MLG Logístico Binário</p> <p>2.4. Pressupostos, Diagnóstico e Envelope</p> <p>3. Introduçao à análise de séries temporais</p> <p>3.1. Definições</p> <p>3.2. Tendência, Sazonalidade, Estacionaridade</p> <p>3.3. Funções de autocorrelacão e autocorrelacão parcial</p> <p>3.4. Modelos de Box e Jenkis</p> <p>3.4.1. Identificacão do modelo ARIMA</p> <p>3.4.2. Estimacão do modelo ARIMA</p> <p>3.4.3. Diagnóstico do modelo ARIMA</p> <p>3.4.4. Previsão</p> <p>4. Uso do software livre R para todos os itens anteriores</p>		
<p>METODOLOGIA:</p> <p>- Aulas teóricas, de exercícios e práticas, utilizando o software livre R e Gretl.</p>		

AVALIAÇÃO:

2 (duas) provas teóricas (P1 e P2) e um trabalho (T). As duas provas e o trabalho terão nota na escala de 0-10 pontos. A nota final (NF) será dada pela seguinte equação:

$$NF = P1 \times 0,4 + P2 \times 0,4 + T \times 0,2.$$

- (i) O aluno será aprovado se obter nota final maior ou igual a 6,0 e 75% de presença.
- (ii) Ao término do curso, haverá uma avaliação substitutiva envolvendo toda a matéria. A nota na prova substitutiva substitui a menor das notas entre as provas P1 e P2.

Se um aluno perder alguma prova, deverá entrar com pedido de 2º chamada de prova na Dicon, anexando o pedido o motivo da perda da avaliação. Após aprovação da Dicon e do Coordenador de curso, o aluno terá direito a 2º chamada de prova.

Bibliografia Básica

[1] DRAPER, Norman Richard; SMITH, Harry. Applied regression analysis. 3.ed. New York: John Wiley & Sons, 1998. 706 p. (Wiley series in probability and statistics. Texts and references section). CSA.

[2] MONTGOMERY, Douglas C; PECK, Elizabeth A; VINING, G. Geoffrey. Introduction to linear regression analysis. 4.ed. Hoboken: John Wiley & Sons, 2006. 612 p. (Wiley series in probability and statistics). CTAN.

[3] MORETTIN, Pedro A; TOLOI, Clélia M. C. Análise de séries temporais. 2.ed. São Paulo: Edgard Blücher, 2008. 538 p. (ABE - Projeto Fisher). CSA.

Bibliografia Complementar

[1] BUENO, Rodrigo de Losso da Silveira. Econometria de séries temporais. 2.ed.rev.atual. São Paulo: Cengage Learning, 2012. 341 p. CTAN.

[2] HOSMER, David W.; LEMESHOW, Stanley. Applied logistic regression. 2.ed. New York: John Wiley & Sons, 2000. 375 p. (Wiley series in probability and statistics). CSA.

[3] MELLO, Marcio Pupin; PETERNELLI, Luiz Alexandre. Conhecendo o R: uma visão mais que estatística. Viçosa: Ed. UFV, 2013. 222 p. Campus Sete Lagoas.

Luís Muquita Silva

Assinatura do Professor (a)

Data : 25/07/2022

Assinatura do Coordenador do Curso

Data: / /2022