



UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
FACULDADE DE CIÊNCIAS INTEGRADAS DO PONTAL
CURSO DE CIÊNCIAS CONTÁBEIS

FICHA DE DISCIPLINA

DISCIPLINA: Métodos Quantitativos

CÓDIGO: GFB020

UNIDADE ACADÊMICA: FACIP

PERÍODO/SÉRIE: 3º PERÍODO

CH TOTAL
TEÓRICA:

CH TOTAL
PRÁTICA:

CH TOTAL:

OBRIGATÓRIA: (X) OPTATIVA: ()

60

-

60

OBS:

PRÉ-REQUISITOS:

CÓ-REQUISITOS:

OBJETIVOS

O objetivo da disciplina é oferecer uma compreensão dos instrumentos básicos de tratamento de dados, para que os alunos sejam capazes de realizar análises empíricas, que os possibilitem tomar decisões no ambiente profissional e/ou que possam fornecer embasamento para pesquisas acadêmicas.

EMENTA

1. Introdução sobre conceitos básicos e importância da análise empírica para contadores, administradores e economistas
2. O modelo de regressão simples
3. O modelo de regressão múltipla
4. Regressão múltipla sobre variáveis binárias (*dummies*)
5. Heterocedasticidade, autocorrelação serial e multicolinearidade
6. Noções de análise de séries temporais

DESCRIÇÃO DO PROGRAMA

1. Introdução sobre conceitos básicos e utilidade da análise de regressão
 - 1.1. O significado da análise empírica
 - 1.2. Metodologia: formulação da teoria ou hipótese, especificação do modelo matemático, obtenção dos dados, estimativa do modelo econométrico, teste da hipótese, previsão
 - 1.3. A estrutura, tipo e fonte dos dados
 - 1.4. As noções de causalção e correlação na análise de regressão
2. Regressão linear simples
 - 2.1. Pressuposições do modelo de regressão linear simples
 - 2.2. Modelo estatístico de uma regressão linear simples
 - 2.3. A função de regressão amostral
 - 2.4. A função de regressão populacional
 - 2.5. O método dos mínimos quadrados ordinários (MQO)
 - 2.6. Propriedades dos estimadores de MQO (Teorema de Gauss-Markov)
 - 2.7. Análise dos resíduos
 - 2.8. Estimador de máxima verossimilhança (EMV)
 - 2.9. Erros-padrão das estimativas por mínimos quadrados
 - 2.10. Coeficiente de correlação de Pearson e coeficiente de determinação
3. Regressão linear múltipla
 - 3.1. Razões para o uso do modelo de regressão múltipla
 - 3.2. Determinação e a interpretação dos estimadores MQO
 - 3.3. Variâncias e erros-padrão dos estimadores MQO
 - 3.4. Propriedades dos estimadores MQO
 - 3.5. O coeficiente múltiplo de determinação R^2
 - 3.6. R^2 e o R^2 ajustado
 - 3.7. Coeficientes de correlação parcial
 - 3.8. Apresentação dos resultados da regressão
4. Regressão múltipla com variáveis binárias (ou *dummies*)
 - 4.1. Descrição de informações qualitativas
 - 4.2. Uma única variável explicativa qualitativa
 - 4.3. Uso de variáveis *dummies* com múltiplas categorias
5. Violação dos pressupostos clássicos da análise de regressão linear
 - 5.1. Multicolinearidade
 - 5.2. Heterocedasticidade
 - 5.3. Autocorrelação serial
6. Noções de análise de séries temporais
 - 6.1. Processo estocástico estacionário
 - 6.2. Teste de estacionariedade com base no correlograma
 - 6.3. Teste de raiz unitária (ADF)
 - 6.4. Processos estocásticos de tendência estacionária e de diferença estacionária
 - 6.5. Exemplificações de modelagem de séries temporais:
 - 6.5.1. Modelo de Vetores Auto-Regressivos (VAR)
 - 6.5.2. Teste de Causalidade de Granger

BIBLIOGRAFIA

- BUSSAZ, W. O. Análise de Variância e de Regressão- Métodos quantitativos. Editora Atual, 1996.
- DOWNING, D. e CLARK, J. Estatística Aplicada. 2ª ed. São Paulo: Saraiva. 2003.
- FREUND, J. E.; SIMON, G. A. Estatística Aplicada. Porto Alegre: Bookman, 2000.
- GUJARATI, D. N. Econometria Básica. Rio de Janeiro: Elsevier, 2006.
- HOFFMANN, Rodolfo. Estatística para Economistas. 4 ed. São Paulo: Thomson Pioneira. 2006.
- KAZMIER, L. J. Estatística Aplicada à Administração e Economia. Rio de Janeiro: Makron Books, 1982.
- MORETTIN, P. e TOLOI, C. Análise de Séries Temporais. Editora Blucher, 2004
- PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D. L. Econometria. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.
- SARTORIS, A. Estatística e Introdução à Econometria. São Paulo: Saraiva, 2003.
- STENVENSON, W. J. Estatística Aplicada à Administração. São Paulo: Harbra, 1986.
- STOCK, J.H. e WATSON, M.W. Econometria. Pearson Education do Brasil, 2004.
- TRIOLA, M. F. Introdução à Estatística. 7. ed. Rio de Janeiro: LTC – Livros Técnicos e Científicos Editora, 1999.
- VASCONCELOS, M. A. S. (Org) Manual de Econometria. São Paulo: Atlas, 2000.
- VERÍSSIMO, M. P. Fluxos de Capitais de Portfólio para o Brasil no Período 1995-2002: Uma Análise de Vetores Auto-regressivos e de Causalidade. Dissertação de Mestrado. Instituto de Economia. Universidade Federal de Uberlândia (UFU), Capítulo 3. Fevereiro. 2002.

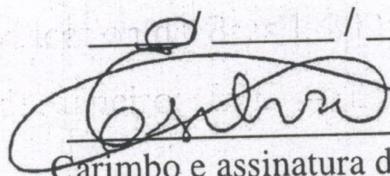
APROVAÇÃO

_____/_____/_____

Carimbo e assinatura do Coordenador do curso

gov.br

Documento assinado digitalmente
THIAGO ALBERTO DOS REIS PRADO
Data: 26/01/2023 18:16:18-0300
Verifique em <https://verificador.iti.br>

_____/_____/_____

Carimbo e assinatura do Diretor da
Unidade Acadêmica

UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
Faculdade de Administração, Ciências Contábeis
Engenharia de Produção e Serviço Social - FACES/UFU
Prof.ª Dr.ª Edileusa da Silva
Diretora da FACES - Portaria SEI R. Nº 499/2019