



Programa de Disciplina

1. Identificação

Cód. Disciplina	Período	Créditos	Carga Horária	
02004	8º	04	Semanal	Mensal
			04	60

Nome da Disciplina

TÓPICOS EM MÉTODOS QUANTITATIVOS APLICADOS À ECONOMIA

Curso

CIÊNCIAS ECONÔMICAS

2. Pré-Requisito

--

3. Ementa

Inferência estatística. Análise de regressão simples. Análise de regressão múltipla. Tópicos em métodos quantitativos aplicados à economia. Séries temporais financeiras. Modelos de análise de decisão e risco. Análise de correspondência.

4. Objetivos

4.1. Objetivo Geral:

- Desenvolver o raciocínio e a compreensão de modelos de regressões simples e múltipla, aplicados em dados *cross section*, painel e em séries temporais.

4. Objetivos

4.2. Objetivos Específicos:

- Identificar os aspectos essenciais da pesquisa científica;
- Identificar os elementos essenciais de um projeto de pesquisa;
- Planejar as etapas de elaboração de uma monografia;
- Elaborar um projeto de pesquisa para a monografia;

Atenção! É sempre bom lembrar que a consecução destes objetivos depende, em grande parte, do esforço participativo dos alunos, razão pela qual se recomenda a leitura prévia da bibliografia indicada.

5. Conteúdo Programático

PARTE I: CONCEITOS DE INFERÊNCIA

1. Amostragem e amostra
2. Inferência sobre médias e proporções
3. Erro amostral
4. Margem de erro
5. Tamanho da amostra
6. Intervalo de confiança
7. Pesquisa de mercado e audiência

PARTE II: REGRESSÃO LINEAR SIMPLES

1. Modelos probabilísticos
2. Hipóteses do modelo
3. Coeficiente de correlação
4. Coeficiente de determinação
5. Análise da validade do modelo

PARTE III: REGRESSÃO LINEAR ÚLTIPLA

1. Hipóteses do modelo
2. Coeficiente de correlação
3. Coeficiente de determinação
4. Análise da validade do modelo
5. Variáveis "Dummy"
6. Análise de resíduos

PARTE IV: SÉRIE TEMPORAL

1. Conceituação
2. Componentes da série sazonal (tendência, sazonalidade, irregularidade).
3. Modelagens possíveis
4. Análise dos modelos obtidos

PARTE V: MODELOS DE ANÁLISE DE DECISÃO E RISCO

1. Conceituação da árvore de decisão
2. Formato da árvore de decisão
3. Montagem e solução da árvore de decisão (MVE – Maior Valor Esperado)
4. Análise de sensibilidade
5. Valor da informação

PARTE VI: ANÁLISE DE CORRESPONDÊNCIA

1. Conceituação
2. Análise de associação
3. Análise de similaridade
4. Metodologia
5. Aplicação

6. Procedimentos Pedagógicos / Metodologia

- Os procedimentos didáticos consistem em aulas expositivas com questionamento e diálogo; seminários; debates; trabalhos em grupo e/ou individual em sala e extra-as; pesquisa bibliográfica e de campo, e visitas a biblioteca.
- Nesta perspectiva, todas as reflexões necessárias para a consecução de cada etapa do processo de pesquisa serão analisadas e discutidas ao longo do semestre.
- Fica claro, então, que a disciplina assume implicitamente que a busca científica precisa submeter-se ao controle e ao teste experimental (empírico). Isso não significa, em hipótese alguma, que as demais concepções de ciência sejam consideradas “erradas” ou que esta disciplina irá fornecer “receitas de bolo” ao assumir uma concepção, procurar-se-á compara-las a outras e analisá-las criticamente.

7. Sistemática de Avaliação

- Ao longo do semestre cada aluno deverá realizar 03 (três) avaliações escritas. Desta forma os instrumentos para que os objetivos da disciplina sejam alcançados são aulas expositiva-interativa, que cobrirão todas as unidades previstas.
- Cada aluno deverá preparar 03 (três) atividades de pesquisa, livremente escolhido, dentre os livros listados na bibliografia: uma que inclua Análise de Regressão Múltipla, outra de Tópicos em Métodos Quantitativos Aplicados a Economia e uma outra de Séries Temporais Financeiras.
- Cada avaliação e atividade de pesquisa deverão ser entregues a cada um terço da carga horária cumprida, respectivamente.
- Quanto a aprovação, seguem-se os critérios da Sistemática de Avaliação da FEST.

8. Bibliografia

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

MATOS, Orlando C. **Econometria Básica: Teoria E Aplicações**. 3ª Ed. São Paulo: Atlas, 2000.

GUAJARATI, Damondar N.; **Econometria Básica**. 3ª Ed. São Paulo: Makron Books, 2000.

HOFFMANN, Rodolfo. **Análise de Regressão – Uma Introdução À Econometria**. 3ª Ed. São Paulo: Hucitec, 1998.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

_____. **Estatística Para Economistas**. 3ª Ed. São Paulo: Pioneira, 2001.

LEVIN, Jack. **Estatística Aplicada as Ciências Humanas**. 2ª Ed. São Paulo: Harbra, 1987.

SPIGEL, Murray R. **Estatística**. 3ª Ed. São Paulo: Makron Books, 1993.

VASCONCELLOS, M. A. S., Alves, D. **Manual de Econometria: Nível Intermediário**. São Paulo: Atlas, 2000.

DONAIRe, Denis & Martins, G. De A. **Princípios de Estatística**. 4ª Ed. São Paulo: Atlas, 1998.

PINDYCK, Robert S. **Econometria: modelos e previsões**. Colaboração de Daniel L. Rubinfeld. 4. ed. Rio de Janeiro-RJ: Campus, 2004. 726 p., il. ISBN 85-352-1343-0.

Local

Imperatriz - Maranhão

Nome do Professor

CLAUDIO MARCOS SOUSA MORAES

AGOSTO / 2009