

PROGRAMA DA DISCIPLINA

RCC4703 Análise de Regressão

TRIMESTRE: 3/2024

TERÇA-FEIRAS: 08:00 - 13:00HORAS

Prof. Dr. Marcelo Botelho da Costa Moraes
mbotelho@usp.br

JUSTIFICATIVA E OBJETIVO

Objetivos:

O objetivo da disciplina é apresentar ao aluno os conceitos e técnicas de análise de regressão para aplicações em contabilidade, controladoria e finanças. O objetivo específico é fornecer aos discentes conhecimentos de como coletar e processar dados, utilizando modelos de regressão linear simples e múltipla, regressão logística e regressão com dados em painel, além de variações, permitindo a descrição e entendimento dos fenômenos estudados.

Justificativa:

As técnicas de análise de regressão formam o principal conjunto de ferramentas para a análise de dados, observando relações de causalidade em sua análise. A disciplina possibilita a capacitação do aluno às aplicações e à compreensão destes métodos nas pesquisas em contabilidade, controladoria e finanças.

EMENTA

- Pré Tratamento dos Dados e Pressupostos Estatísticos;
- Definições de Exogeneidade/Causalidade;
- Regressão Linear Simples;
- Regressão Linear Múltipla;
- Análise Discriminante;
- Regressão Logística;
- Dados em Painel: POLS, Efeitos Fixos e Efeitos Aleatórios;
- GMM e Variáveis Instrumentais;
- Modelos Dinâmicos;
- Diferenças em Diferenças;
- Efeitos de Moderação;
- Regressão Multinível.

AVALIAÇÃO

Atividade	Peso	Obs.
<input checked="" type="checkbox"/> Prova Final	30 %	(1)
<input checked="" type="checkbox"/> Participação e discussão em aula	20 %	(2)
<input checked="" type="checkbox"/> Avaliação do relatório de dados (artigo)	50 %	(3)

SOBRE PRESENÇA MÍNIMA:

A presença mínima obrigatória deve seguir o regimento do programa.

INSTRUÇÕES DETALHADAS SOBRE ATIVIDADES COMPLEMENTARES

- Participação e discussões em aula: toda a bibliografia de Leitura Mínima deve ser lida previamente à aula, bem como os artigos para discussão. Os alunos serão questionados sobre o contexto, aplicação e conteúdo dos artigos e leitura mínima, sendo a participação avaliada pela qualidade apresentada nas discussões e pró atividade de participação ao longo do semestre. A cada aula será solicitada o envio de análise do artigo indicado de leitura, devendo ser enviado pelo e-disciplinas.

- Prova Final: Prova individual com conteúdo total apresentado, sendo realizada em computador pessoal, com consulta ao material próprio.

- Relatório de Dados / Artigo: o artigo escrito será elaborado ao longo do curso em dupla, demonstrando a utilização exclusivamente de uma ou mais técnicas apresentadas na disciplina. Espera-se que os alunos possam ter a capacidade de desenvolver um trabalho de pesquisa com uso correto de técnicas de análise de regressão. O artigo não pode ser em coautoria com outro docente ou orientador (exceto seja desenvolvido individualmente na disciplina) e não deve apresentar conflito de interesse e/ou sobreposição com a pesquisa da dissertação/tese, de maneira a inviabilizar a pesquisa e gerar dupla contagem de créditos (na disciplina e na dissertação/tese).

A entrega do artigo final será em 23/12/2024.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

AULA	DATAS	TÓPICOS E LEITURA NECESSÁRIA
1	17/09	- Pré Tratamento dos Dados e Pressupostos Estatísticos; - Definições de Exogeneidade/Causalidade; - Regressão Linear Simples. <input checked="" type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova. LEITURA MÍNIMA: Wooldridge (2013) capítulos 2 ao 8 (OU) Gujarati e Porter (2011) capítulos 1 ao 9
	26/09	ENANPAD – NÃO HAVERÁ AULA
2	24/09	- Regressão Linear Múltipla; - Análise Discriminante; - Regressão Logística. <input checked="" type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova. LEITURA MÍNIMA: Gujarati e Porter (2011) capítulo 15 LEITURA ADICIONAL: A definir
3	01/10	- Dados em Painel: POLS, Efeitos Fixos e Efeitos Aleatórios; - GMM e Variáveis Instrumentais; - Modelos Dinâmicos. <input checked="" type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova. LEITURA MÍNIMA: Wooldridge (2013) capítulos 13 ao 15 (OU) Gujarati e Porter (2011) capítulo 16 LEITURA ADICIONAL: A definir
4	08/10	Programação STATA e R. <input type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input checked="" type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova.
5	15/10	- Diferenças em Diferenças; - Propensity Score Matching; - Efeitos de Moderação. <input checked="" type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova. LEITURA MÍNIMA: Hansen (2019) capítulo 18; Wooldridge (2011) capítulo 18; Hernán e Robins (2020) capítulo 15 e 19 LEITURA ADICIONAL: A definir
6	22/10	- Regressão Quantílica; - Regressão Multinível. <input checked="" type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova. LEITURA MÍNIMA: Angrist e Pischke (2008) capítulo 7; Fávero e Belfiori (2017) Capítulo 16 LEITURA ADICIONAL: A definir
7	29/10	Programação STATA e R. <input type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input checked="" type="checkbox"/> Exercícios, <input type="checkbox"/> Prova.
8	05/11	Prova Final <input type="checkbox"/> Aula Expositiva, <input type="checkbox"/> Discussão dos textos, <input type="checkbox"/> Apresentação de alunos, <input type="checkbox"/> Exercícios, <input checked="" type="checkbox"/> Prova.
23/12/2024		Entrega do Artigo da disciplina no e-disciplinas

LEITURA MÍNIMA

ANGRIST, Joshua D.; PISCHKE, Jörn-Steffen. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion, 2008.
FÁVERO, Luiz Paulo; BELFIORI, Patrícia. Manual de Análise de Dados. Ed. Elsevier, 2017.
GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. Econometria Básica – 5ª Edição, 2011.
HANSEN, Bruce E. Econometrics. University of Wisconsin, 2019.
HERNÁN, Miguel A.; ROBINS, James, M. Causal Inference – What If. CRC Press – Taylor & Francis Group, 2020.
WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. Cengage Learning, 5ª Edition, 2011.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. *Introductory Econometrics – A Modern Approach*. Cengage Learning, 5ª Edition, 2013.

Artigos: Todos os artigos estão disponíveis no e-disciplinas.

LEITURA COMPLEMENTAR

- FÁVERO, Luiz Paulo; BELFIORE, Patrícia. *Manual de Análise de Dados: Estatística e Modelagem Multivariada com Excel, SPSS e STATA*. Elsevier, 2017.
- HAIR Jr., J. F., BLACK, W. C., BABIN, B. J., ANDERSON, R. E., TATHAM, R. L. *Análise Multivariada de Dados*. 6ª Edição. Bookman, 2009.
- WOOLDRIDGE, Jeffrey M. *Introdução à Econometria – Uma Abordagem Moderna*. 4. ed. São Paulo: Cengage, 2011.
- GUJARATI, Damodar N.; PORTER Dawn, C. *Econometria Básica*. 5. ed. Porto Alegre: Bookman, 2011.
- BROOKS, Chris. *Introductory econometrics for finance*. Cambridge University Press. 3.ed. 2014.