

**MBA
USP
ESALQ**

Analytics para Modelos de Risco e Gestão em Projetos de Data Science

Prof. Dr. Fabiano Guasti Lima

Analytics para Modelos de Risco e Gestão em Projetos de Data Science

- Definição de um Problema
- Ferramentas Necessárias:
 - Amostragem
 - Estatísticas Descritivas
 - Testes Estatísticos de Hipóteses
 - Análise Fatorial
 - Análise de Clusters
 - Simulações de Monte-Carlo
 - Análise de Correlações
 - Regressões (Linear, Múltipla, Logística, Paineis)

- Sugestões de Leitura:

Livro: FÁVERO, Luiz Paulo, BELFIORE, Patrícia. **Manual de Análise de Dados:** Estatística e Modelagem Multivariada com Excel®, SPSS® e Stata®. Rio de Janeiro: Elsevier, 2017.

Analytics para Modelos de Risco e Gestão em Projetos de Data Science

- Ferramentas Necessárias:

- Análise de Variância (ANOVA)
- Análise de Séries Temporais
- Árvores de Decisão e Classificação
- Fuzzy Logic
- Algoritmos Genéticos
- Análise de Sobrevivência
- Modelos Econométricos

- Sugestões de Leitura:

Artigo: Francisco, E. de R., KUGLER, J. L., Kang, S. M., Silva, R., Whigham, P. A. (2019). Além da tecnologia: desafios de gerenciamento na era de Big Data [Versão traduzida]. *RAE-Revista de Administração de Empresas*, 59(6), 375-378.

<http://dx.doi.org/10.1590/S0034-759020190603>

Artigo: FÁVERO, Luiz Paulo Lopes. Dados em painel em contabilidade e finanças: teoria e aplicação. *Brazilian Business Review – BBR*. v.10, n.1, jan.-mar. 2013

<https://www.redalyc.org/pdf/1230/123025719006.pdf>