

PROGRAMA		
CURSO:	Mestrado Profissional em Administração	
DISCIPLINA:	Análise Avançada de Informações	PERÍODO: 3º Tri 2013
PROFESSOR:	Nilton Cardoso	CARGA HORÁRIA: 36 horas
E-MAIL:	NiltonDMCJ@insper.edu.br	
HORÁRIO DE ATENDIMENTO:	Sob demanda	

I – OBJETIVO

Esta disciplina consiste em fornecer as ferramentas de análise de dados quantitativos e a aplicação das ferramentas atualmente disponíveis. Nesta disciplina, enfatizará a capacidade de ler e compreender as hipóteses apresentadas em trabalhos empíricos publicados em periódicos. O aluno também terá seu primeiro contato com a modelagem de experimentos envolvendo o uso de dados quantitativos para testar hipóteses e teorias na área de economia da estratégia. Graças aos aplicativos econométricos disponíveis no Insper, e descritos na seção sobre Infra-Estrutura, o aluno também se familiarizará com métodos computacionais, com o mínimo de programação que esses aplicativos exigem para seu melhor aproveitamento sobretudo freqüentando as oficinas (com Andres Rojas).

II – EMENTA

1. Introdução
 - 1.1. Análise empírica
 - 1.2. Estruturas de dados (Cross-sections, Séries de tempo, Dados em painel)
2. Variáveis aleatórias
 - 2.1. Variáveis unidimensionais (revisão)
 - 2.2. Variáveis bidimensionais
 - 2.2.1. Inferências e condição
 - 2.2.2. Covariância e correlação
3. Inferências estatísticas
 - 3.1. Distribuição Amostral e Intervalo de confiança (revisão)
 - 3.2. Testes de Hipóteses para 1 população (revisão)
 - 3.3. Testes de Hipóteses para 2 populações
 - 3.4. ANOVA
4. Regressão linear simples
 - 4.1. Estimação e testes de hipóteses
 - 4.2. Análise de resíduos
5. Regressão múltipla
 - 5.1. Estimação e testes de hipóteses
 - 5.2. Análise de resíduos
 - 5.3. Utilização de variáveis dummy
 - 5.3.1. Análises de interação com o uso de variáveis dummy
 - 5.4. Multicolinearidade
 - 5.5. Heteroscedasticidade
 - 5.6. Auto-correlação
6. Introdução a modelos para variáveis dependentes qualitativas
 - 6.1. Modelo logístico
 - 6.2. Modelo Probit
 - 6.3. Modelo Tobit

III – CONTEÚDO PROGRAMÁTICO		
PARTE	TÓPICOS	LEITURA BÁSICA
Aula 1 30/07/13 Terça	1. Introdução 1.1. Análise empírica 1.2. Estruturas de dados (Cross-sections, Séries de tempo, Dados em painel) 2. Inferências estatísticas 2.1. Distribuição Amostral e Intervalo de confiança (revisão) 2.2. Testes de Hipóteses para 1 população (revisão) 2.3. Testes de Hipóteses para 2 populações 2.4. ANOVA	Levine et Alli., caps. 1 a 10; Art.1
Aula 2 06/08/13 Terça	3. Regressão linear simples 3.1. Estimacão e testes de hipóteses 3.2. Análise de resíduos	Wooldridge, cap.2 Levine et Alli., cap. 11.
Aula 3 13/08/13 Sexta	4. Regressão múltipla 4.1. Estimacão e testes de hipóteses 4.2. Análise de resíduos	Wooldridge, cap. 8
Aula 4 20/08/13 Terça	4. (continuação) Regressão múltipla 4.1. Estimacão e testes de hipóteses 4.2. Análise de resíduos	Wooldridge, cap. 8 Art. 2
Aula 5 27/08/13 Terça	4.3. Utilização de variáveis dummy 4.3.1. Análises de interação com o uso de variáveis dummy	Wooldridge, cap. 7 Art. 3
Aula 6 30/08/13 Sexta	Prova intermediária	
Aula 7 03/09/13 Terça	4.4. Multicolinearidade	Wooldridge, cap.8 Art. 4

Aula 8 06/09/13 Sexta	4.5. Heteroscedasticidade 4.5.1. Conseqüências na estimação 4.5.2. Detectando a existência de heteroscedasticidade 4.5.3. Método de mínimos quadrados generalizados	Wooldridge, cap.8
Aula 9 10/09/13 Terça	4.6.Auto-correlação 4.6.1. Conseqüências na estimação 4.6.2. Testes para detectar auto-correlação 5.6.3. M. de mínimos quadrados generalizados	Wooldridge, cap.12 Art. 5
Aula 10 17/09/13 Terça	5. Introdução a modelos para variáveis dependentes qualitativas 5.1. Modelo logístico	Wooldridge, cap.17
Aula 11 24/09/13 Terça	5.(Cont) Introdução a modelos para variáveis dependentes qualitativas 5.2. Modelo Probit 5.3. Modelo Tobit	Wooldridge, cap.17
Aula 12 01/10/13 Terça	Prova Final	Toda a matéria

IV – Oficinas com Andrés Rojas (favor sempre confirmar horários com o Andrés. andresfmr@gmail.com)
16/ago (19:30- 21:00); 24/ago (09:00-10:30) e mesmo dia 13:00-15:00); 14/set e 21/set, ambas das 09:00 às 10:30; 27/set às 19:30 até 21:00.

V – BIBLIOGRAFIA BÁSICA

1.	Wooldridge, J.M., 2006, Introdução à Econometria, Uma Abordagem Moderna, 684 p., Thomsom.
2.	Levine, D., Stephan, D., Krehbiel, T., Berenson, M., Estatística – Teoria e Aplicações Usando o Microsoft Excel em Português, 3ª. Ed., LTC Editora, 2005.
3.	Greene, W.H., 2008, Econometrics Analysis, 1178 p., Pearson.

VI- BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR (artigos, vários referenciados pelo MIT OpenCourseWareEconomics 14.32, Econometrics, Spring 2007)	
4.	Stock, J. H. e Watson, M.W., 2004, Econometria, 485 p., Pearson.
5.	Keller, G., Statistics for management and economics, 7a. ed. New York, Thomson, 2005
Art 1	Tópico: Intervalos de confiança =>Woodbury, S.A., andR. Spiegelman. "Bonuses to Workers and Employers to Reduce Unemployment: Randomized Trials in Illinois" <i>American Economic Review</i> 77, no.4 (September 1987): 513-530.
Art 2	Tópico: Variáveis omitidas=> Krueger, A. "How Computers Have Changed the Wage Structure : Evidence from Micro Data". <i>Quarterly Journal of Economics</i> 108, no. 1 (February 1993): 33-60.
Art 3	Tópico: Variáveis dummies e interações, testando restrições lineares usando testes F =>DiNardo, J. eJ.S. Pischke. "The Returns to Computer Use Revisited: Have Pencils Changed the Wage Structure Too?" <i>The Quarterly Journal of Economics</i> 112, no.1 (February 1997): 291-303.
Art 4.	Tópico: Análise de regressão de experimentos naturais, diferenças em diferenças =>Krueger, A. eS.B. Dale."Estimating the Payoff to Attending a More Selective College: An Application of Selection on Observables and Unobservables." <i>The Quarterly Journal of Economics</i> 117 (November 2002): 1491-1529.
Art 5.	Tópico: Correlação serial, teste de Durbin-Watson=>Graddy, K. "Testing for Imperfect Competition at the Fulton Fish Market." <i>RAND Journal of Economics</i> 26, no.1 (Spring 1995): 75-92.

VII – CRITÉRIOS DE APROVAÇÃO		
Avaliação	Sigla	Peso %
1. Prova Intermediária	PI	30%
2. Participação em aula e lista de exercícios	LI	10%
3. Prova final	PF	60%