

Oficina PPGCC - Programação em R

Seu nome

2023-09-26

1 Trazendo informações da base de dados

1.1 Exemplo da Karsten

No ano de 2023, a empresa Karsten SA (CTKA4.SA) teve receita total igual a R\$ 380 milhões.

Por outro lado, as empresas do seu setor *Consumer Cyclical*s tiveram receita total média de R\$ 2.664 milhões.

Segundo Matsumoto et al. (2012) e Dias et al. (2023), ...

2 Análise de dados

Segundo a Tabela 1, ...

Table 1: Estatísticas descritivas

| | n | mean | sd | median | mad | min | max | range | skew | kurtosis |
|--------|------|-------|-------|--------|------|-------|--------|--------|------|----------|
| ATC | 1703 | 4074 | 11950 | 790 | 1085 | 0 | 168607 | 168607 | 8 | 83 |
| PTC | 1703 | 3050 | 9096 | 543 | 742 | 0 | 136287 | 136287 | 8 | 76 |
| ATR | 1703 | 13848 | 59612 | 2034 | 2734 | 0 | 987419 | 987419 | 12 | 168 |
| EBITDA | 1703 | 1622 | 8018 | 176 | 268 | -5504 | 145036 | 150540 | 13 | 183 |
| RT | 1703 | 7491 | 25016 | 1092 | 1505 | 0 | 321638 | 321638 | 8 | 79 |
| TAM | 1703 | 8 | 2 | 8 | 2 | -5 | 14 | 19 | 0 | 2 |
| ROA | 1703 | 0 | 1 | 0 | 0 | -19 | 1 | 20 | -25 | 760 |
| MS | 1703 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 | 6 | 48 |
| IHH | 1703 | 1686 | 1626 | 928 | 488 | 589 | 8266 | 7677 | 2 | 6 |

Resultados para as regressões por MQO:

Resultados para as regressões por MQO, efeitos fixos e efeitos aleatórios:

References

Dias, R. M., Chambino, M., Teixeira, N., Alexandre, P., and Heliodoro, P. (2023). Balancing portfolios with metals: A safe haven for green energy investors?

Matsumoto, A., Merlone, U., and Szidarovszky, F. (2012). Some notes on applying the herfindahl–hirschman index. *Applied Economics Letters*, 19(2):181–184.

Table 2:

| | <i>Dependent variable:</i> | | | | |
|-------------------------|----------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|------------------------------|
| | EBITDA | | | | |
| | (1) | (2) | (3) | (4) | (5) |
| ATC | −0,161*** (0,018) | −0,162*** (0,018) | −0,161*** (0,018) | −0,162*** (0,018) | −0,156*** (0,018) |
| ATR | 0,145*** (0,002) | 0,146*** (0,002) | 0,145*** (0,002) | 0,146*** (0,002) | 0,148*** (0,003) |
| PTC | 0,092*** (0,020) | 0,092*** (0,020) | 0,092*** (0,020) | 0,090*** (0,020) | 0,095*** (0,020) |
| ROA | | 139,925 (98,602) | | 137,873 (98,590) | |
| TAM | | | −2,264 (31,627) | | |
| MS | | | | | −2 978,818*** (1 091,208) |
| IHH | | | | −0,049 (0,037) | −0,039 (0,037) |
| Constant | −14,024 (62,267) | −21,570 (62,475) | 2,014 (232,529) | 58,632 (86,273) | 83,887 (86,122) |
| Observations | 1 703 | 1 703 | 1 703 | 1 703 | 1 703 |
| R ² | 0,912 | 0,912 | 0,912 | 0,912 | 0,912 |
| Adjusted R ² | 0,911 | 0,911 | 0,911 | 0,911 | 0,912 |

Note:

*p<0,1; **p<0,05; ***p<0,01

Table 3:

| | <i>Dependent variable:</i> | | |
|-------------------------|------------------------------|-------------------------------|------------------------------|
| | EBITDA | | |
| | Pooled OLS | Efeitos fixos | Efeitos aleatórios |
| | (1) | (2) | (3) |
| MS | 64 280,990*** (1 853,982) | -23 020,360*** (6 621,069) | 42 417,030*** (3 545,603) |
| IHH | 0,197** (0,086) | -1,640*** (0,402) | 0,035 (0,168) |
| TAM | 82,096 (71,909) | 504,079** (198,816) | 435,639*** (124,191) |
| Constant | -1 367,725** (565,078) | | -3 060,360*** (1 020,525) |
| Observations | 1 703 | 1 703 | 1 703 |
| R ² | 0,513 | 0,032 | 0,125 |
| Adjusted R ² | 0,513 | -0,184 | 0,123 |

Note:

*p<0,1; **p<0,05; ***p<0,01