Disciplina: Fundamentos de Data Analytics II - análise multivariada

Professor: Daniel Reed Bergmann

|  |
| --- |
| **Objetivo da disciplina** |
| Estudar os principais modelos de ciência de dados usados em finanças e investimentos com uma abordagem teórica e com aplicação e discussão de casos práticos |

|  |
| --- |
| **Mini CV Professores** |
| Professor Doutor de Finanças e Economia da FEA-USP  Professor de Ciência de Dados da Saint Paul e do LIT  Head de Consultoria de Ciência de Dados pela Epistemics Ltda |

|  |
| --- |
| **Conteúdo programático** |
| **Fundamentos de Data Analytics II - análise multivariada**  Carga horária: 15 horas  Regressão Múltipla   * Conceitos e estatísticas * Aplicações em finanças e investimentos   Regressão logística   * Conceitos e estatísticas * Aplicações em crédito   Análise de Clusters   * Conceitos e estatísticas * Aplicações em finanças e investimentos |

|  |  |
| --- | --- |
| **Plano de aula** | |
| **Aula** | **Tema e conteúdo** |
| Aula 1 | Revisão de Regressão e Aplicações |
| Aula 2 | Aplicações com Risco de Mercado e Operações Long & Short |
| Aula 3 | Regressão Múltipla |
| Aula 4 | Regressão Logística |
| Aula 5 | Regressão Logística |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Bibliografia básica** | | |
| MAIA, Alexandre Gori. **Econometria: conceitos e aplicações**. Saint Paul Editora, 2019. | | |
| **Bibliografia complementar** | | |
|  | | |
| ***Método de avaliação*** | | |
| **Avaliação** | **Participação** |  |
| Trabalho | 100% | Resolução de um caso prático |