



LISBON
SCHOOL OF
ECONOMICS &
MANAGEMENT
UNIVERSIDADE DE LISBOA

U LISBOA

UNIVERSIDADE
DE LISBOA

ANÁLISE DE DADOS EM FINANÇAS

Mestrado em Contabilidade, Fiscalidade e Finanças Empresariais
(Ano Lectivo 2018/2019)

Docentes: Esmeralda A. Ramalho, ISEG/UL (eramalho@iseg.ulisboa.pt) e João Cruz, ISEG/UL (joaocruz@iseg.ulisboa.pt)

OBJECTIVOS

Numa época de rápido desenvolvimento e avanço nas áreas computacionais, os métodos estatísticos têm vindo a assumir um papel fundamental no domínio da modelação, previsão e interpretação de fenómenos de natureza económica, financeira e de gestão. Pretende-se com a unidade curricular de Análise de Dados em Finanças aprofundar conhecimento básicos de estatística, incluindo o modelo de regressão linear e algumas das suas extensões, numa optica aplicada, com recurso a software estatístico apropriado.

PROGRAMA

- Introdução à análise de dados: dados e gráficos, estatísticas descritivas
- Inferência estatística
- Testes de hipótese paramétricos
- Testes de ajustamento e tabelas de contingência
- Testes de hipóteses não paramétricos
- Tópicos de estatística multivariada: análise de clusters e análise factorial
- Regressão linear para dados seccionais
- Introdução a um dos complementos de regressão: modelos para dados binários ou modelos lineares para dados de painel

METODOLOGIA

A metodologia de ensino adoptada consiste na formação presencial, em sala de computação. Consiste essencialmente na exposição de conteúdos teóricos, acompanhada de exemplos práticos e ilustrada pela via da exploração de conjuntos de dados reais com recurso a software (Excel, SPSS e STATA)

AVALIAÇÃO DE CONHECIMENTOS

A avaliação da UC em **Época Normal** é constituída por **um Trabalho/Estudo de Caso**, realizado por grupos de 4 a 5 alunos, e por uma prova escrita individual, realizada com consulta de material de apoio em formato papel. A ponderação de cada um dos dois elementos de avaliação é de 50%, sendo que a classificação mínima admissível na prova final é de 7 valores. Caso o resultado decorrente desta ponderação seja inferior ao decorrente da ponderação de 100% atribuída à prova final, a nota final corresponderá a esta ultima classificação.

A avaliação da UC em **Época de Recurso** é constituída por um Exame Escrito (ponderação de 100%).

TRABALHO DE GRUPO/ESTUDO DE CASO (formato de artigo, sem ultrapassar as 15 páginas de texto + anexo contendo os outputs relevantes provenientes do Excel, SPSS, STATA, ou outro software adequado) – entrega a 13 de Dezembro de 2018

- Definição do problema e escolha das variáveis (justificação económica da escolha) e abordagens potencialmente apropriadas
- Breve revisão da literatura empírica sobre o tema
- Recolha e descrição dos dados
- Aplicação de testes estatísticos para comparar grupos de empresas/instituições/...
- Análise econométrica: especificação, estimação e análise de especificação do(s) modelo(s) e interpretação económica de sinais e magnitude dos coeficientes
- Conclusão: contribuições para o problema formulado, limitações do estudo e linhas de investigação a explorar futuramente

BIBLIOGRAFIA BASE

Newbold, P., Carlson, W. & Thorne, N. (2013). Statistics for Business and Economics. 8th ed.
Pearson

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

Wooldridge, J. (2013) Introductory Econometrics – A Modern Approach, 5th ed., South-Western