

Planos de Ensino – ADE – Ciências Atuariais

Nome da Unidade Curricular: 5182 - ANÁLISE DE DADOS APLICADA	
Departamento Responsável: Ciências Atuariais	
Curso: Ciências Atuariais	
Professor(a) Responsável (% CH): Prof. Ms. Luiz Augusto Finger França Maluf (100%)	
Ano Letivo: 2020	Semestre: 6º
Termo: 6	Categoria da UC:
Dia da semana e horário: Sextas-Feiras (14-18h – Integral) & (19-23h – Noturno)	
<p>Atividades Síncronas: Aulas via plataforma Google Meet por conta institucional laffmaluf@unifesp.br nas seguintes datas: 10/07/2020, 24/07/2020, 31/07/2020, 07/08/2020, 14/08/2020, 21/08/2020, 28/08/2020, 04/09/2020, 11/09/2020, 18/09/2020, 25/09/2020, 02/10/2020. Em razão do Congresso Acadêmico da UNIFESP de 2020, não haverá atividade síncrona durante a semana de sua realização.</p> <p>Essas datas correspondem às sextas-feiras pertencentes ao semestre letivo. O horário das atividades serão os seguintes: para a turma do curso integral, das 14:00 às 16:00h. Para a turma do curso noturno, das 19:00 às 21:00h.</p>	
<p>METODOLOGIA DE ENSINO</p> <p>O curso será ministrado através de aulas expositivas por meio de encontros semanais com os alunos no GOOGLE MEET e exercícios programados disponibilizados, discutidos e entregues por meio plataforma GOOGLE CLASSROOM. O acesso a ambas as plataformas por parte dos alunos será exclusivamente por meio das contas Google@unifesp.br de cada aluno, o que garantirá a capacidade de controle de acesso e segurança do ambiente virtual de ensino.</p> <p>O total de aulas/encontros relacionados para cada tópico do programa deverá ser dividido em aulas expositivas e práticas (apresentação e formalização dos conceitos teóricos e de exemplos práticos com o uso do R), além de exercícios extra-classe, indicados pelo professor e desenvolvidos pelos alunos individualmente em seus computadores pessoais com o uso do software R, editores de texto, planilhas eletrônicas e acesso à internet.</p> <p>As aulas expositivas via Google Meet terão a exibição de slides elaborados em Power Point e serão disponibilizados em versão PDF na plataforma Google Classroom. As aulas serão gravadas e o acesso posterior será compartilhado na plataforma Google Classroom por meio de um link para o vídeo salvo no Google Drive. O software R e suas bibliotecas poderão ser baixados e instalados livremente por meio do website https://cran.r-project.org/.</p>	

METODOLOGIA DE AVALIAÇÃO

O aluno será avaliado do seguinte modo:

- a) Exercícios entregues de forma individual referentes ao conteúdo das aulas postados e discutidos de forma assíncrona na plataforma Google Classroom e nos encontros síncronos via Google Meet. A entrega dos exercícios será feita exclusivamente de forma assíncrona, por meio da plataforma Google Classroom.
- b) A assiduidade será contabilizada pelo percentual de atividades entregues pelo aluno na plataforma Google Classroom em relação ao total de atividades e exercícios solicitados pelo professor nessa mesma plataforma, devendo os alunos entregarem no mínimo 75% dos exercícios

O conceito final da unidade curricular "cumprido/não cumprido".

REFERÊNCIAS BIBLIOGRÁFICAS

BÁSICA:

BUENO, Rodrigo De Losso Silveira. *Econometria das Séries Temporais*. 2ª Ed. Cengage Learning, 2012. ISBN-13: 9788522111572.

MORETTIN, Pedro Alberto. *Econometria Financeira: um curso em séries temporais financeiras*. 2ª Ed. São Paulo: Blucher, 2011.

HALL, A.R. *Generalized Method of Moments*. Series: Advanced Text in Econometrics. Oxford. 2005. (Disponível na UNIFESP pela base de dados ebrary:

<http://site.ebrary.com/lib/unifespbr/reader.action?docID=10254408>)

COMPLEMENTAR:

BRASIL. Instituto de Pesquisa Econômica Aplicada. Ipeadata. Disponível em: <<http://www.ipeadata.gov.br>>.

ECONOMÁTICA - Tools for Investment Analysis (n.d.). Base de Dados [CD-ROM]. São Paulo.

ENDERS, Walter. *Applied Econometric Time Series*. 3rd. Ed. Wiley, 2009.

MATTOS, T.B. *Modelos Não Lineares e Suas Aplicações*. UFJF. Instituto de Ciências Exatas. Graduação em Estatística (Monografia). 2013. Disponível em: <<http://www.ufjf.br/cursoestatistica/files/2014/04/Modelos-N%C3%A3o-Lineares-e-suas-Aplica%C3%A7%C3%B5es.pdf>>. Acesso em: Out. 2014.

RUSSON, M. G. The Intuition and Methodology of Value at Risk. *Review of Business*, v.29, n.1, p. 39-50, 2008, Proquest ebrary. Disponível em: <<http://search.proquest.com/docview/220968069?accountid=26670>>.

Cronograma de aulas semanais

Semana	Data	Conteúdo	Práticas Pedagógicas	Carga horária
1	Ocorreu presencialmente em 06/03/2020	Apresent. Disciplina; Estimadores de Máxima Verossimilhança	Presencial	4
2	Ocorreu presencialmente em 13/03/2020	Matriz de Var-Covar; Erro-Padrão dos Estimadores dos EMV; Significância dos EMV;	Presencial	4
3	06 a 11 de Julho	Matriz de Var-Covar; Erro-Padrão dos Estimadores dos EMV; Significância dos EMV - Implementação em R	Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom. Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.	2 2
4	13 a 18 de Julho	Congresso Acadêmico da UNIFESP	O certificado de participação dos alunos no Congresso Acadêmico lhes dará direito a 4 horas de atividade nesta disciplina, referente a essa semana.	4
5	20 a 25 de julho	Medidas de Bondade do Ajuste (MSE, RMSE, MAE, MAPE)	Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom. Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.	2 2
6	27 de julho – 01 de agosto	Modelos de Crescimento Não Lineares: Modelo Logístico, Gompertz.	Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom. Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.	2 3

7	03 a 08 de Agosto	Introdução aos Processos Estocásticos: Processos Estacionários e Não Estacionários; Séries Temporais; FAC e FACP	<p>Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom.</p> <p>Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.</p>	2 3
8	10 a 15 de agosto	Introdução aos Processos Estocásticos: Processos Estacionários e Não Estacionários; Séries Temporais; FAC e FACP	<p>Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom.</p> <p>Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.</p>	2 3
9	17 a 22 de Agosto	Retornos; Log Retornos	<p>Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom.</p> <p>Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.</p>	2 3
10	24 a 29 de Agosto	Modelos AR, MA, ARMA e ARIMA	<p>Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom.</p> <p>Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.</p>	2 3
11	24 a 29 de agosto	Modelos AR, MA, ARMA e ARIMA	<p>Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom.</p>	2

			Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.	3
12	31 de Agosto a 05 Setembro	Modelos GARCH e VaR	Aula síncrona via Google Meet: aula expositiva com apresentação de slides elaborados em Power Point, apresentação de exemplos com o uso do software R e resolução de dúvidas. A aula será gravada e disponibilizada na plataforma Google Classroom.	2
			Exercícios indicados para realização de forma assíncrona, discutidos e entregues pelos alunos na plataforma Google Classroom.	3
13	07 a 12 de setembro	Devolutiva das avaliações	Aula síncrona via Google Meet resolução de dúvidas	2
			Interação com os alunos na plataforma Classroom e por e-mail.	3
Total				60