



MINISTÉRIO DA CIÊNCIA E DO ENSINO SUPERIOR
DIRECÇÃO-GERAL DO ENSINO SUPERIOR
INSTITUTO POLITÉCNICO DE TOMAR

ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

Licenciatura Bi-Etápica em Gestão de Comércio e Serviços

Estatística

Regime: Anual

Ano Lectivo: 2006/07

Ano / Semestre: 2º

Carga Horária Semanal: 2 T + 2 P

Docentes: Prof Adjunto Francisco Carvalho

Assistente do 1º Triénio Ricardo Covas

Objectivos

Pretende-se dotar os estudantes dos conhecimentos necessários ao tratamento e análise de dados, nomeadamente no que diz respeito a variáveis e indicadores económicos, pondo ênfase nas análises de estudos de mercados.

Programa

Cap. I – Estatística Descritiva

- 1.1 – Considerações preliminares
- 1.2 – Vocabulário Estatístico
- 1.3 – Apresentação dos Dados
- 1.4 – Distribuição de Frequências
- 1.5 – Medidas de Estatística Descritiva
 - 1.5.1 – Medidas de Localização: Tendência Central. Tendência Não Central
 - 1.5.2 – Medidas de Dispersão
 - 1.5.3 – Medidas de Assimetria
 - 1.5.4 – Medidas de Achatamento ou Curtose
 - 1.5.4 – Medidas de Concentração: Curva de Lorenz e Índice de Gini.

Cap. II – Introdução ao Estudo das Probabilidades

- 2.1 – Introdução
- 2.2 – Definições Gerais
- 2.3 – Leis de Probabilidade
- 2.4 – Probabilidade Condicionada. Teorema de Bayes

Cap. III - Distribuição de Probabilidades:

- 3.1 - Variáveis Aleatórias Discretas
- 3.2 - Variáveis Aleatórias Contínuas
- 3.3 – Distribuição Binomial
- 3.4 – Distribuição de Poisson
- 3.5 – Distribuição Normal. Distribuição Normal $N(0,1)$.
- 3.6 – Referência a outras distribuições discretas e contínuas

Cap. IV – Estimação Estatística

- 4.1 – Algumas Considerações
- 4.2 – Estimação Pontual
- 4.3 – Intervalos de Confiança

Cap. V – Testes de Hipóteses

- 5.1 – Conceitos Básicos
- 5.2 – Nível de Significância
- 5.3 – Estudo de alguns Testes de Hipóteses
- 5.4 – Teste do Qui-Quadrado

Cap. VI – Números Índices

- 6.1 – Conceitos Básicos
- 6.2 – Propriedades dos Índices Simples, Agregados ou Compostos
- 6.3 – Índices Compósitos ou Sintéticos
- 6.4 – Índice de Preços e de Quantidades: Laspeyres e Paasches
- 6.5 – Deflação de Séries Cronológicas

Cap. VII – Regressão e Correlação

- 7.1 – Considerações Preliminares
- 7.2 – O Método de Regressão Linear Simples: Método dos Mínimos Quadrados
- 7.3 – Análise do Grau de Associação entre Variáveis



Cap. VIII – Controle Estatístico de Qualidade

- 8.1 – Objectivos e Fases do Controlo de Qualidade
- 8.2 – Gráficos de Controle de Variáveis
- 8.3 – Gráficos de Controle de Atributos

Cap. IX – Regressão Múltipla

- 9.1 – Modelos Econométricos Uniequacionais
- 9.2 – Modelo de Regressão Múltipla
- 9.3 – Estimadores
- 9.4 – Regressão *Stepwise*
- 9.5 – Linearização de Modelos Não-Lineares
- 9.6 – Variáveis Dummy
- 9.7 – Testes t e F
- 9.8 – Teste Chow
- 9.9 – Regressão *Picewise*
- 9.10 – Correlação Serial, Heteroscedasticidade, Multicolinearidade
- 9.11 – Modelos Econométricos Multiequacionais
 - 9.11.1 – Introdução: O problema da Correlação entre variáveis explicativas e o termos estocástico. O método das variáveis Instrumentais
 - 9.11.2 – O Método dos Mínimos Quadrados Indirectos
 - 9.11.3 – O Método dos Mínimos Quadrados Duplos ou Bi-Etápicas

Cap. X – Análise de Séries Temporais

- 10.1 – Conceito de Sucessão Cronológica
- 10.2 – Processos Estocásticos Estacionários
- 10.3 – Processos Estacionários Lineares
- 10.4 – Processos Não Estacionários Lineares

Cap. XI – Testes Não Paramétricos

- 11.1 - Teste Binomial
- 11.2 – Teste do sinal
- 11.3 – Teste de aderência
- 11.4 – Teste de *Kolmogorov-Smirnov*
- 11.5 – Teste de independência

Cap. XII – Sondagens

- 12.1 – Conceitos e Indicadores de Qualidade
- 12.2 – Plano de Amostragem
 - 12.2.1 – Etapas do Plano Amostral
 - 12.2.2 – Amostras Aleatórias
 - 12.2.3 – amostras Não Aleatórias
- 12.3 – Dimensão da Amostra

Avaliação

A avaliação em época de frequência será constituída por três frequências e trabalhos práticos, sendo a nota final a média aritmética das três e dos trabalhos ponderados, respectivamente em 70% e 30%. Só serão elegíveis à segunda frequência os alunos que tiverem nota igual ou superior a 6.5 valores. A média das frequências será feita com as notas efectivamente obtidas. Dispensarão de Exame os alunos cuja nota de frequências seja superior a dez valores (10.0 valores).

Bibliografia

- GUIMARÃES, Rui Cerqueira; CABRAL, José Sarsfield – *Estatística* – MacGraw Hill, 1997
- HARNETT, D. L. – *Introduction to Statical Methods*
- INTRILIGATOR, Michael D. – *Econometric Models, Technics, & Aplications* – Prentice-Hall, Inc
- LEAVENWORTH, G. – *Statistics Quality Control*, McGraw Hill, 1989
- MURTEIRA, B.J. – *Análise Exploratória de Dados* – McGraw Hill
- MURTEIRA, B.J. – *Probabilidades e Estatística, Vol I e Vol II* – McGraw Hill
- MURTEIRA, B.J. et al – *Análise de Sucessões Cronológicas* – McGraw Hill
- MURTEIRA, B.J., BLACK, G.H. – *Estatística Descritiva*, McGraw Hill
- NAYLOR, Thomas H.; VERNON, Jonh M.; WERTZ, Kenneth L. – *Managerical Economics* – McGraw-Hill Book Company
- NEWBOLD, Paul – *Statistics fo Business and Economics* – Printice-Hall International, Inc.
- OLIVEIRA, M.M. et al – *Econometria* – Exercícios – Edições Sílabo
- PINDYCK, Robert S.; RUBINFELD, Daniel L. – *Econometric models and Economic Forcast* – McGraw-Hill Book Company
- REIS, Elizabeth – *Estatística Descritiva* – Edições Sílabo
- ROBALO, António – *Estatística – Exercícios, Vol I e Vol II* – Edições Sílabo
- SIEGEL, A.F. – *Statistics and Data Analysis*, John Wiley & Sons, 1988
- SPIEGEL, M.R. – *Probabilidades e Estatística*, McGraw Hill, 1978

*Com a presença de
Ass. Prof. C. Brindley*

Francisco Leal