



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

ESCOLA SUPERIOR DE GESTÃO DE TOMAR

Francisco Carvalho
Ricardo Covas

Licenciatura Bi-Etápica em Gestão de Empresas

Programa

2004 / 2005

Estatística II

Docente: Professor Adjunto Francisco Carvalho
Assistente 1º Triénio Ricardo Covas

Estatística II



Regime: Semestral

Ano / Semestre: 2º / 2º

Carga Horária Semanal: 2 T + 3 P

Docente: Prof Adjunto Francisco Carvalho
Assistente 1º Triénio Ricardo Covas

Objectivos

Pretende-se dotar os estudantes de conhecimentos complementares na área da Estatística, tocando pontos de econometria, estatística não paramétrica, e análise de sucessões cronológicas.

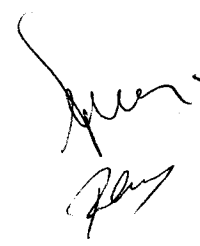
Programa

Cap. I – Regressão e Correlação

- 1.1 – Modelos Econométricos Uniequacionais e o Método dos Mínimos Quadrados
- 1.2 – Modelo de Regressão Múltipla
- 1.3 – Estimadores
- 1.4 – Regressão *Stepwise*
- 1.5 – Linearização de Modelos Não-Lineares
- 1.6 – Variáveis Dummy
- 1.7 – Testes t e F
- 1.8 – Teste Chow
- 1.9 – Regressão *Picewise*
- 1.10 – Correlação Serial, Heteroscedasticidade, Multicolinearidade
- 1.11 – Modelos Econométricos Multiequacionais
 - 1.11.1 – Introdução: O problema da Correlação entre variáveis explicativas e o termos estocástico. O método das variáveis Instrumentais
 - 1.11.2 – O Método dos Mínimos Quadrados Indirectos
 - 1.11.3 – O Método dos Mínimos Quadrados Duplos ou Bi-Etápicas

Cap. II – Análise de Séries Temporais

- 2.1 – Conceito de Sucessão Cronológica
- 2.2 – Processos Estocásticos Estacionários
- 2.3 – Processos Estacionários Lineares
- 2.4 – Processos Não Estacionários Lineares



Cap. III – Testes Não Paramétricos

- 3.1 - Teste Binomial
- 3.2 – Teste do sinal
- 3.3 – Teste de aderência
- 3.4 – Teste de *Kolmogorov-Smirnov*
- 3.5 – Teste de independência

Cap. IV – Sondagens

- 4.1 – Conceitos e Indicadores de Qualidade
- 4.2 – Plano de Amostragem
 - 4.2.1 – Etapas do Plano Amostral
 - 4.2.2 – Amostras Aleatórias
 - 4.2.3 – amostras Não Aleatórias
- 4.3 – Dimensão da Amostra

Avaliação

A avaliação em época de frequência será constituída por uma frequência e pela apresentação de trabalhos práticos, com uma ponderação de 70% e 30% respectivamente, sendo a nota final a média ponderada da frequência e dos trabalhos. Dispensarão de Exame os alunos cuja média seja superior a dez valores (10.0 valores).

Bibliografia

- BOX, HUNTER and HUNTER – Statistics for Experimenters: An Introduction to design, Data Analysis and Model Building, 1970
- HARNETT, D. L. – Introduction to Statical Methods
- INTRILIGATOR, Michael D. – Econometric Models, Technics, & Aplications – Prentice-Hall, Inc
- 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. – Managerial
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
Forecast – McGraw-Hill Book Company
SIEGEL, A.F. – Statistics and Data Analysis, John Wiley & Sons, 1988

