

Estatística II
Licenciaturas em Economia e Finanças
2º Semestre - 2023/2024
PROGRAMA

1ª Parte: Estatística

1. Estimação
 - 1.1 Introdução e métodos de estimação por pontos (MSRASP 7.1 e 7.2)
 - 1.2 Propriedades dos estimadores por pontos (MSRASP 7.3)
 - 1.3 Intervalos de confiança (MSRASP 7.5)
2. Testes de hipóteses
 - 2.1 Introdução. Teste de hipótese simples contra hipótese simples - lema de Neyman-Pearson (MSRASP 8.1 e 8.2)
 - 2.2 Testes de hipóteses simples contra hipóteses compostas; valor-p (MSRASP 8.3 e 8.4)
 - 2.3 Testes para populações normais (MSRASP 8.5 e 8.6)
 - 2.4 Testes para populações não normais – grandes amostras (MSRASP 8.7)
3. Testes não paramétricos
 - 3.1 Introdução e teste de ajustamento (MSRASP 9.1 e 9.2)
 - 3.2 Tabelas de contingência e teste de independência (MSRASP 9.3)

2ª Parte: Econometria

1. Introdução
 - 1.1 Relações teóricas e empíricas (W 1.1 e 1.2)
 - 1.2 Tipos de dados económicos (W 1.3)
 - 1.3 Causalidade e o valor esperado condicional (W 1.4)
2. Modelo de regressão linear múltipla
 - 2.1 Motivação e interpretação (W 3.1)
 - 2.2 O método dos mínimos quadrados (W 3.2 e E.1; 6.2 - modelos com logaritmos e 6.3)
 - 2.3 Propriedades estatísticas e alguns tópicos (W 3.3 a 3.6, e E.2)
3. Inferência estatística
 - 3.1 Distribuição amostral do estimador dos mínimos quadrados (W 4.1 e E.3)
 - 3.2 Intervalos de confiança (W 4.3)
 - 3.3 Testes de hipóteses sobre um parâmetro (W 4.2)
 - 3.4 Testes de hipóteses sobre uma combinação linear de parâmetros (W 4.4)
 - 3.5 Testes de hipóteses sobre várias combinações lineares de parâmetros (W 4.5)
4. Heterocedasticidade
 - 4.1 Motivação e consequências (W 8.1)
 - 4.2 Estimção consistente da matriz de covariâncias (W8.2)
 - 4.3 Testes para deteção de heterocedasticidade (W 8.3)
5. Previsão
 - 5.1 Previsão pontual e por intervalos de confiança para a média (W 6.4)
 - 5.2 Previsão pontual e por intervalos de confiança para uma unidade particular (W 6.4)
6. Tópicos sobre formas funcionais
 - 6.1 Termos quadráticos e interações (W 6.2)
 - 6.2 Teste RESET da forma funcional (W 9.1)

BIBLIOGRAFIA

Murteira, B., Silva Ribeiro, C., Andrade e Silva, J., Pimenta, C. e Pimenta, F., (2015). Introdução à Estatística, Escolar Editora. [MSRASP]

Wooldridge, J. M. (2016), Introductory Econometrics: a Modern Approach, 6th. ed., Cengage Learning. [W]