

ISEG - INSTITUTO SUPERIOR DE ECONOMIA E GESTÃO
Universidade Técnica de Lisboa

Estatística II
Licenciaturas em Economia e Finanças
2º semestre - 2012/2013

PROGRAMA

1ª Parte: Estatística

1. Estimação

- 1.1 Introdução e métodos de estimação pontual (MSRASP 7.1 e 7.2)
- 1.2 Propriedades dos estimadores pontuais (MSRASP 7.3)
- 1.3 Intervalos de confiança (MSRASP 7.5)

2. Testes de hipóteses

- 2.1 Introdução ao 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 (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 (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 simples

- 2.1 Definições (W 2.1)
- 2.2 O método dos mínimos quadrados (W 2.2 a 2.4)

3. Modelo de regressão linear múltipla

- 3.1 Motivação e interpretação (W 3.1 e 3.2 e E.1)
- 3.2 Propriedades estatísticas e alguns tópicos (W 3.3 a 3.5, 6.1 a 6.3 e E.2)

4. Inferência estatística

- 4.1 Distribuição amostral e o estimador dos mínimos quadrados (W 4.1 e E.3)
- 4.2 Testes de hipóteses sobre um parâmetro (W 4.2)
- 4.3 Intervalos de confiança (W 4.3)
- 4.4 Testes de hipóteses sobre uma combinação linear de parâmetros (W 4.4)
- 4.5 Testes de hipóteses sobre várias combinações lineares de parâmetros (W 4.5)

5. Propriedades assintóticas do estimador dos mínimos quadrados

- 5.1 Consistência (W 5.1)
- 5.2 Normalidade assintótica e inferência (W 5.2)
- 5.3 Eficiência (W 5.3)

6. Heterocedasticidade

- 6.1 Motivação e consequências (W 8.1)
- 6.2 Estimação consistente da matriz de covariâncias (W8.2)
- 6.3 Testes para detecção de heterocedasticidade (W 8.3)
- 6.4 Estimação de modelos heterocedásticos (W 8.4)

7. Previsão

- 7.1 Previsão pontual e pró intervalos (W 6.4)
- 7.2 Previsão em modelos log-lineares (W 6.4)

8. Tópicos sobre formas funcionais

- 8.1 Escala (W 6.1)
- 8.2 Modelos log-lineares
- 8.3 Termos quadráticos e interaccções (W 6.2)
- 8.4 Testes de forma funcional (W 9.1)

BIBLIOGRAFIA

Murteira, B; Silva Ribeiro, C.; Andrade e Silva, J. e Pimenta, C. (2010). *Introdução à Estatística*, Escolar Editora. [MSRASP]

Wooldridge, J. M. (2009). *Introductory Econometrics, A Modern Approach*, 4th Ed., Thomson South-Western. [W]

AVALIAÇÃO DE CONHECIMENTOS

- **Provas escritas individuais** - constituem a componente fundamental da avaliação de conhecimentos. Estas provas realizam-se nas épocas previstas pelo RGAC: normal, de recurso e especial.
Para efeitos de obtenção de nota positiva, nenhuma das provas escritas será complementada por uma prova oral.
- **Consulta** - na realização das provas escritas referidas acima os estudantes poderão utilizar os seguintes elementos de consulta (disponíveis para download na página da cadeira), *ambos da responsabilidade do aluno e não fornecidos pela equipa docente*:
 - formulário oficial da cadeira
 - tabelas estatísticas
- **Classificação superior a 17 valores** - Os alunos que obtenham classificação superior a 17 valores em qualquer das provas referidas serão solicitados a realizar uma prova complementar de carácter individual, que poderá consistir num trabalho escrito ou numa prova oral. A não realização desta prova complementar implica a classificação final de 17 valores (que também é a classificação mínima assegurada aos alunos que a realizarem).
- Se nalguma das épocas especiais de exame o número de alunos inscritos for inferior ou igual a 10, a prova escrita poderá ser substituída por uma prova oral.

EQUIPA DOCENTE:

Docente	Contacto	Tipo de Aulas	Turnos
Nicoletta Rosati (Responsável)	nicoletta@iseg.utl.pt Gab. 510 Quelhas	Teóricas Práticas	A01 T01
Pedro Leão	pleao@iseg.utl.pt Dep. Economia	Práticas	T02, T03