

ISEG - INSTITUTO SUPERIOR DE ECONOMIA E GESTÃO
Universidade de Lisboa

Estatística II
Licenciaturas em Economia e Finanças
2º Semestre - 2014/2015

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 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 múltipla

- 2.1 Motivação e interpretação (W 3.1)
- 2.2 O método dos mínimos quadrados (W 3.2 e E.1)
- 2.3 Propriedades estatísticas e alguns tópicos (W 3.3 a 3.5, 6.2, 6.3 e E.2)

3. Inferência estatística

- 3.1 Distribuição amostral do estimador dos mínimos quadrados (W 4.1 e E.3)
- 3.2 Testes de hipóteses sobre um parâmetro (W 4.2)
- 3.3 Intervalos de confiança (W 4.3)
- 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. Propriedades assintóticas do estimador dos mínimos quadrados

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

5. Heterocedasticidade

5.1 Motivação e consequências (W 8.1)

5.2 Estimação consistente da matriz de covariâncias (W8.2)

5.3 Testes para detecção de heterocedasticidade (W 8.3)

6. Previsão

6.1 Previsão pontual e por intervalos de confiança para a média (W 6.4)

6.2 Previsão pontual e por intervalos de confiança para uma unidade particular (W 6.4)

7. Tópicos sobre formas funcionais

7.1 Termos quadráticos e interações (W 6.2)

7.2 Testes da 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. (2013) [W], [*Introductory Econometrics: a Modern Approach*](#), 5th. ed., International Edition, 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:
 - um formulário
 - as tabelas estatísticasO formulário e as tabelas encontram-se publicados na página da disciplina e é da responsabilidade dos alunos trazê-los no dia da prova. Estes elementos não podem ter nenhuma anotação nem qualquer outro conteúdo que não seja feito pela equipa de docentes. O não cumprimento desta norma é considerado fraude decorrente de cópia sendo aplicado o Artigo 12º do RGAC das Licenciaturas.
- **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	Horário de atendimento
Isabel Proença (Responsável)	isabelp@iseg.ulisboa.pt Gab. 201, Quelhas 2	Teóricas	A01	Contatar a docente
Ana Regina Pereira	anapereira@iseg.ulisboa.pt	Práticas	T01	Contatar a docente
Bruno Damásio	bdamasio@iseg.ulisboa.pt Gab. 102, Quelhas 4	Práticas	T02 T03	Contatar o docente

PROGRAMAÇÃO DAS AULAS

Capítulo do Programa	Teóricas	Práticas
1ª Parte	12	7
1. Estimação	6	4
2. Testes de hipóteses	4	2
3. Métodos não paramétricos	2	1
2ª Parte	13	6
1. Introdução	1	
2. O modelo de regressão linear múltipla	4	2
3. Inferência estatística	2	1
4. Propriedades assintóticas do estimador dos mínimos quadrados	1	
5. Heterocedasticidade	2	1
6. Previsão	2	1
7. Tópicos sobre formas funcionais	1	1
Total	25	13
Total de aulas disponíveis	26	13

Responsável:

Isabel Proença

 Email: isabelp@iseg.utl.pt