

MÉTODOS ESTATÍSTICOS

Mestrado em Gestão e Estratégia Empresarial

Ano letivo 2015/16 – 2º semestre

PROGRAMA DETALHADO

1. Amostragem e Distribuições por Amostragem

- 1.1 Conceito de distribuição por amostragem (6.1)
- 1.2 Distribuição por amostragem da média (6.2 sem Monte Carlo Simulations)
- 1.3 Distribuição por amostragem da proporção (6.3)
- 1.4 Distribuição por amostragem da variância (6.4)

2. Estimação e Intervalos de Confiança

- 2.1 Estimação pontual (7.1)
- 2.2 Intervalo de confiança para a média da distribuição normal com variância conhecida (7.2)
- 2.3 Intervalo de confiança para a média da distribuição normal com variância desconhecida (7.3)
- 2.4 Intervalo de confiança para a proporção (7.4)
- 2.5 Intervalo de confiança para a variância da distribuição normal (7.5)
- 2.6 Duas populações: tópicos adicionais (8.1 e 8.2 sem o caso de variâncias desconhecidas e não assumidas como iguais)

3. Testes de Hipóteses Paramétricas

- 3.1 Conceitos básicos (9.1)
- 3.2 Teste para a média da distribuição normal com variância conhecida (9.2)
- 3.3 Teste para a média da distribuição normal com variância desconhecida (9.3)
- 3.4 Teste para a proporção (9.4)
- 3.5 Cálculo da potência do teste (9.5)
- 3.6 Teste para a variância da distribuição normal (9.6)
- 3.7 Teste para a diferença de médias de duas populações normais – amostras emparelhadas (10.1)
- 3.8 Teste para a diferença de médias de duas populações normais, amostras independentes - com variâncias conhecidas e com variâncias desconhecidas mas iguais (10.2)
- 3.9 Teste para a diferença de duas proporções (10.3)

4. Testes de Hipóteses Não Paramétricas

- 4.1 Teste de ajustamento (14.1 e 14.2 sem teste de normalidade)
- 4.2 Teste de independência (14.3)

5. Modelo de Regressão Linear: Especificação, Estimação, Testes

- 5.1 Introdução (12.1)
- 5.2 Estimação dos coeficientes (12.2)
- 5.3 Avaliação do poder explicativo do modelo (12.3)
- 5.4 Intervalos de confiança e testes de hipóteses (12.4)
- 5.5 Testes sobre os coeficientes da regressão (12.5)
- 5.6 Previsão (12.6)

Nota: entre parêntesis encontram-se os correspondentes pontos no livro base da bibliografia