



Estatística Apresentação

Prof. Fabio Hideki Ono
Junho/2006



Manual do Candidato - Programa

- 1. Números-índices.** Índices de Laspeyres e de Paasche. Propriedades ideais de um número índice. Mudança de base e deflacionamento de dados.
- 2. Probabilidade** - Definição e propriedades. Variáveis aleatórias discretas e contínuas. Função de probabilidade e densidade de probabilidade. Distribuição conjunta, distribuição marginais, independência estatística. Esperança matemática e variância de uma variável aleatória. Covariância e coeficiente de correlação.
- 3. Principais distribuições:** Bernoulli, Binomial, Poisson, Geométrica, Hipergeométrica, Uniforme, Normal, Lognormal, Qui-quadrado, t e F.
- 4. Principais teoremas de probabilidade.** Teorema de Tchebycheff. Lei dos grandes números. Teorema Central do Limite.
- 5. Inferência estatística.** Estimação por ponto e por intervalo. Propriedades desejáveis dos estimadores em pequenas e grandes amostras. Intervalo de confiança e teste de hipóteses. Tipos de erro. Nível de significância.
- 6. Análise de Regressão.** O modelo clássico de regressão linear e suas hipóteses básicas. Estimadores de mínimos quadrados ordinários e suas propriedades. Intervalos de confiança e teste de hipóteses. Violação das hipóteses básicas do modelo clássico de regressão linear: testes de diagnóstico e procedimentos de correção. Regressão com variáveis "dummy". Modelos auto-regressivos e de defasagens distribuídas. Modelos de equações simultâneas.
- 7. Introdução a séries de tempo,** modelos auto-regressivos, de média, móveis e mistos. Tendência, passeio aleatório e raízes unitárias.



Manual do Candidato - Bibliografia

a) Básica

1. GUAJARATI, D. Basic Econometric. New York: McGraw-Hill, 1995
2. HOFFMANN, R. Estatística para Economistas. Rio de Janeiro: Pioneira, 1973.
3. KMENTA, J. Elementos de Econometria. São Paulo: Atlas, 1994.
4. MEYER, P. L. Probabilidade – Aplicações à Estatística. São Paulo: Livros Técnicos e Científicos Editora, 1983.
5. TOLEDO, G.L e OVALLE, I.I Estatística Básica. São Paulo: Atlas, 1995.

b) Complementar

6. HILL, C; GRIFFITHS, W & JUDGE,G. Econometria. São Paulo: Saraiva, 2000.
7. MADDALA, G. Introduction to Econometrics. New York: MacMillan.
8. PINDYCK, R. e Rubinfeld, D. Econometric Models and Economic Forecasts. New York: McGraw-Hill.
9. WALPOLE, R. E. – Introduction to Statistics. New York: MacMillan, 1979.



Distribuição das Questões

LEVANTAMENTO DAS QUESTÕES DE ESTATÍSTICA DA ANPEC POR TEMA

Tópico do Programa	TOTAL	Ano															
		91	92	93	94	95	96	97	98	99	00	01	02	03	04	05	06
Números-índices	15	1	1		1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
Probabilidade	87	7	6	7	7	7	8	6	6	3	5	4	5	5	4	4	3
Principais distribuições	24	2	1	2	1	1	2	1	1	3	1	1	2	2	1	1	2
Principais teoremas de probabilidade	10		1	2					1				2	1	1	1	1
Inferência estatística	47	3	3	3	3	4	4	5	2	3	4	3	1	1	4	3	1
Análise de Regressão	39	2	3	1	2	2		2	2	3	3	4	3	3	2	3	4
Introdução a séries de tempo	14									1	1	1	2	1	2	2	2

236



Distribuição das Questões

LEVANTAMENTO DAS QUESTÕES DE ESTATÍSTICA DA ANPEC POR SUBTÓPICO

Tópico do Programa	Subtópico do Programa	TOTAL	Ano															
			91	92	93	94	95	96	97	98	99	00	01	02	03	04	05	06
Números-índices	Índices de Laspeyres e de Paasche	14	1	1		1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1	1
	Mudança de base e deflacionamento de dados	1								1								
Probabilidade	Estatística Descritiva	9	1	1		1	1	1	2	1						1		
	Definição e propriedades (Conjuntos)	9	1			1	1	1	1	1	1	1		1				
	Função de probabilidade e densidade de probabilidade	27	2	1	3	1	2	2	2	2		1	2	1	2	3	1	2
	Esperança matemática e variância	27	2	2	4	1	2	3	1	1	1	2	1	2	2		2	1
	Covariância e coeficiente de correlação	17	2	2	2		1	1	1	2	2			1	1	1	1	1
	Cálculo de Probabilidade	20	2	1	1	3	2	1	1	1	1	1	1	2	2	1	1	1
	Principais distribuições	24	2	1	2	1	1	2	1	1	3	1	1	2	2	1	1	2
Principais teoremas de probabilidade	Teorema de Tchebycheff	7		1	1					1				2	1		1	
	Teorema Central do Limite e Grandes Números	5		1						1				1		1	1	
Inferência estatística	Propriedades dos Estimadores	16	1		2		1	3	3	1	1	1		1	1	1		
	Estimadores de MQO	5		1	1			1				1					1	
	Estimadores de Máxima Verossimilhança	6							1		1	3				1		
	Intervalo de confiança	7		1		1				1			1				2	1
	Testes de Hipóteses e Nível de Significância	25	2	1	1	2	3	1	2	1	2	1	2	1	2	3	1	
	Tipos de Erros	13	1			1	1		1		1	2	2	1	1		1	1
Análise de Regressão	Regressão Linear	12	2	2		1					2			2	1		1	1
	Regressão por MQO	18	2	1	1	1	1		1	1	1	2	2		2	1	1	1
	Regressão e teste de estimadores	7		1			1		1		1		1	1				1
	Violação das Hipóteses Básicas	9				1	1		1	1	1		1			1		2
	Regressão com Dummies	1										1						
	Modelos de equações simultâneas	7								1			1	1	1	1	1	1
Introdução a séries de tempo	ARMA	8								1	1	1		1	1	1	1	1
	Testes de Raiz Unitária	7											2	1	1	1	1	1
	Tendência e Passeio Aleatório	2											1				1	1

303