

**Contabilidade**

Licenciatura, 1º Ciclo

Plano: Despacho nº 13772/2014 - 12/11/2014

**Ficha da Unidade Curricular: Probabilidades e Estatística**

ECTS: 4; Horas - Totais: 108.0, Contacto e Tipologia, TP:45.0;

Ano | Semestre: 1 | S2

Tipo: Obrigatória; Interação: Presencial; Código: 90569

Área Científica: Matemática

**Docente Responsável**

Luis Miguel Lindinho da Cunha Mendes Grilo

Professor Adjunto

**Docente(s)**

Maria Manuela Morgado Fernandes Oliveira

Assistente 2º Triénio

**Objetivos de Aprendizagem**

1. Conhecer e utilizar os principais conceitos de:
  - 1.1. Estatística descritiva
  - 1.2. Probabilidades e distribuições teóricas de probabilidade
  - 1.3. Estimação e testes de hipóteses
  - 1.4. Regressão linear simples
2. Proceder à análise de dados, interpretar os resultados e proceder à tomada de uma decisão

**Conteúdos Programáticos**

1. Estatística descritiva.
2. Introdução à teoria das probabilidades.
3. Variáveis aleatórias e distribuições teóricas de probabilidade.
4. Estimação estatística e testes de hipóteses.
5. Regressão linear simples.

**Conteúdos Programáticos (detalhado)**

## 1. ESTATÍSTICA DESCRITIVA

### 1.1. Conceitos básicos.

#### 1.1.1. População e amostra.

#### 1.1.2. Fases do método estatístico.

### 1.2. Tipo de dados.

### 1.3. Distribuição de frequências e representação gráfica de dados.

### 1.4. Medidas de estatística descritiva.

#### 1.4.1. Medidas de localização: tendência central e de ordem (Quantis). Identificação e classificação de outliers. Diagrama de extremos e quartis.

#### 1.4.2. Medidas de dispersão.

#### 1.4.3. Medidas de assimetria.

#### 1.4.4. Medidas de achatamento ou curtose.

## 2. INTRODUÇÃO À TEORIA DAS PROBABILIDADES

### 2.1. Algumas notas sobre análise combinatória.

### 2.2. Conceitos básicos.

#### 2.2.1. Experiência aleatória.

#### 2.2.2. Espaço de resultados.

#### 2.2.3. Acontecimentos.

### 2.3. Álgebra dos acontecimentos.

#### 2.3.1. Acontecimento complementar.

#### 2.3.2. União de acontecimentos.

#### 2.3.3. Intersecção de acontecimentos.

#### 2.3.4. Diferença de acontecimentos.

#### 2.3.5. Propriedades das operações entre conjuntos

### 2.4. Leis de probabilidade.

#### 2.4.1. Definição clássica (ou de Laplace) de probabilidade.

#### 2.4.2. Definição frequencista ou empírica.

#### 2.4.3. Axiomatização da teoria das probabilidades

### 2.5. Probabilidade condicionada.

### 2.6. Acontecimentos independentes.

### 2.7. Teorema da probabilidade total e Teorema de Bayes.

## 3. VARIÁVEIS ALEATÓRIAS E DISTRIBUIÇÕES TEÓRICAS DE PROBABILIDADE

### 3.1. Definição de variável aleatória.

### 3.2. Variáveis aleatórias discretas. Função de probabilidade. Função de distribuição. Valor esperado, variância e algumas das suas propriedades. Moda e quantis.

### 3.3. Variáveis aleatórias contínuas. Função de densidade de probabilidade. Função de distribuição. Valor esperado, variância e algumas das suas propriedades. Moda e quantis

### 3.4. Algumas distribuições discretas de probabilidade.

#### 3.4.1. Distribuição Binomial.

#### 3.4.2. Distribuição de Poisson.

#### 3.4.3. Aproximação da distribuição Binomial à distribuição de Poisson.

#### 3.4.4. Referência a outras distribuições discretas: distribuição geométrica e distribuição hipergeométrica.

### 3.5. Algumas distribuições contínuas de probabilidade.

#### 3.5.1. Distribuição Normal (ou de Gauss). Definição, propriedades, uso da tabela da distribuição

normal  $N(0,1)$  e aplicações.

3.5.2. Teorema do Limite Central. Aproximação da distribuição Binomial à distribuição Normal e aproximação da distribuição de Poisson à distribuição Normal.

3.5.3. Referência a outras distribuições contínuas: distribuição Qui-quadrado, distribuição t-Student e distribuição F-Snedcor.

#### 4. ESTIMAÇÃO ESTATÍSTICA E TESTES DE HIPÓTESES

##### 4.1. Estimação estatística

4.1.1. Conceitos básicos sobre estimação: população e parâmetro; amostra e estatística.

4.1.2. Estimação pontual de parâmetros populacionais.

4.1.3. Estimação intervalar de parâmetros populacionais.

##### 4.2. Testes de hipóteses

4.2.1. Conceitos básicos sobre testes de hipóteses: hipótese nula e hipótese alternativa, tipos de testes de hipóteses (unilaterais e bilaterais), tipologia dos erros, estatística de teste e região crítica.

4.2.2. Valor de prova (p-value) de um teste de hipóteses. Realização de testes de hipóteses usando o p-value.

4.2.3. Testes de hipóteses para o valor médio, variância e proporção de uma população.

4.2.4. Testes de hipóteses para a comparação dos valores médios e variâncias de duas populações.

#### 5. REGRESSÃO LINEAR SIMPLES

5.1. Diagrama de dispersão. O modelo de regressão linear simples e a reta dos mínimos quadrados.

5.2. Análise do grau de associação entre variáveis: coeficiente de determinação e coeficiente de correlação linear.

5.3. Inferência no modelo de regressão linear simples.

#### **Metodologias de avaliação**

Avaliação contínua: duas provas escritas, sem consulta, com recurso às plataformas Moodle e Colibri Zoom, cotadas de 0 a 20 valores. A nota final é a média aritmética destas avaliações. Se a nota final for superior a 15 valores o aluno deverá submeter-se a uma prova oral para defesa. Por exame: com recurso às plataformas Moodle e Colibri Zoom, prova escrita, sem consulta, sobre toda a matéria e uma prova oral, ambas cotadas de 0 a 20 valores. A nota do exame corresponde à média aritmética entre as notas obtidas nessas duas provas. Aprovação (em qualquer modalidade): pelo menos 10 em 20 valores.

#### **Software utilizado em aula**

Excel.

#### **Estágio**

Não aplicável.

#### **Bibliografia recomendada**

- Pedrosa, A. e Gama, S. (2016). *Introdução Computacional à Probabilidade e Estatística, com Excel* Lisboa: Porto Editora
- Robalo, A. (1998). *Estatística: Exercícios, Vol I (Probabilidades. Variáveis aleatórias)* Lisboa: Edições Sílabo
- Robalo, A. (2004). *Estatística: Exercícios, Vol II (Distribuições. Inferência Estatística)* Lisboa: Edições Sílabo
- Siegel, A. (1988). *Statistics and Data Analysis: An Introduction* New York: John Wiley & Sons

### **Coerência dos conteúdos programáticos com os objetivos**

Os conteúdos programáticos são coerentes com os objetivos da Unidade Curricular uma vez que:

- o capítulo 1 dos conteúdos programáticos pretende concretizar o ponto 1.1 dos objetivos;
- os capítulos 2 e 3 dos conteúdos programáticos pretendem concretizar o ponto 1.2 dos objetivos;
- o capítulo 4 dos conteúdos programáticos pretende concretizar o ponto 1.3. dos objetivos;
- o capítulo 5 dos conteúdos programáticos pretende concretizar o ponto 1.4. dos objetivos;
- os objetivos referidos no ponto 2 são transversais a todos os capítulos dos conteúdos programáticos.

### **Metodologias de ensino**

Aulas teórico-práticas, em que se expõem e exemplificam as matérias respeitantes a cada um dos conteúdos programáticos, incentivando-se a participação ativa por parte dos alunos. É dada especial ênfase à análise de dados de natureza económica.

### **Coerência das metodologias de ensino com os objetivos**

As metodologias de ensino adotadas permitem a aquisição de conhecimentos de modo progressivo e consolidado, acompanhadas de um estudo sustentado por parte do aluno. A simbiose entre as metodologias da componente teórica e prática pretende promover a análise, interpretação, discussão e resolução de problemas. A transformação dos conceitos em ferramentas de trabalho será atingida através da demonstração da forte interação entre os conceitos e as suas aplicações. O estímulo ao desenvolvimento de uma maior autonomia dos alunos perante um processo de análise, interpretação e tomada de decisão é fundamental para a consolidação dos conhecimentos adquiridos numa perspetiva de uma maior aplicabilidade dos mesmos, por vezes com recurso ao Excel. Deste modo, criam-se condições favoráveis ao cumprimento dos objetivos estabelecidos.

### **Língua de ensino**

Português

### **Pré-requisitos**

Não existem pré-requisitos, contudo recomendam-se conhecimentos de teoria dos conjuntos, análise combinatória, cálculo diferencial e cálculo integral.

**Programas Opcionais recomendados**

Não aplicável.

**Observações**

---

**Docente responsável**

---