

RAD1507 – Estatística Aplicada à Administração I – Diurno

Prof. Dr. Evandro Marcos Saidel Ribeiro

E-mail: esaidel@usp.br, RAD-FEARP-USP

CRONOGRAMA 2018

Sala 1

Aulas: Segunda: 10:00-11:40

Quarta: 08:00-09:40

Data	Dia	Conteúdo	Listas, Trabalhos, Provas	
26/fev	2ª	Apresentação da disciplina; Revisão; Softwares		
28/fev	4ª	Teste de hipótese - uma amostra		
05/mar	2ª	Teste de hipótese - uma amostra	L01	
07/mar	4ª	Teste de hipótese - uma amostra	L02	Trabalho T1
12/mar	2ª	Teste de hipótese - duas amostras		
14/mar	4ª	Teste de hipótese - duas amostras	L03	
19/mar	2ª	Teste de hipótese - várias amostras (ANOVA)		
21/mar	4ª	Teste de hipótese - várias amostras (ANOVA)		Trabalho T2
26/mar	2ª	Semana Santa. Não haverá aula		
28/mar	4ª	Semana Santa. Não haverá aula		
02/abr	2ª	Desenvolvimento para Análise de dados 1	L04	
04/abr	4ª	Análise de Dados 1 – Teste de Hipóteses	L05	Análise A1
09/abr	2ª	Revisão: Teste de hipótese		
11/abr	4ª	1ª Prova – Testes de Hipóteses (Listas 02-07)	L06 e L07	Prova P1
16/abr	2ª	Covariância e Correlação Linear		
18/abr	4ª	Covariância: Análise de Portfólio		
23/abr	2ª	Covariância e Correlação Linear		
25/abr	4ª	Covariância: Análise de Portfólio	L08	
30/abr	2ª	Recesso (Dia do trabalho 1 de Maio)		
02/mai	4ª	Regressão Linear Simples (RLS)		Trabalho T3
07/mai	2ª	RLS: CAPM, Regressão Linear Múltipla		
09/mai	4ª	Regressão Linear Múltipla - Excel e R	L09	
14/mai	2ª	Regressão Linear Múltipla - Excel e R		
16/mai	4ª	Regressão Linear Múltipla - Excel e R	L10	Trabalho T4
21/mai	2ª	Resumo: Covariância, Correlação e Regressão		
23/mai	4ª	Resumo: Covariância, Correlação e Regressão	L11 e L12	
28/mai	2ª	Aula suspensa – problema do abastecimento		
30/mai	4ª	Aula suspensa – problema do abastecimento		
04/jun	2ª	Resumo: Covariância, Correlação e Regressão		
06/jun	4ª	2ª Prova – Covariância, Correlação e Regressão	L13 e L14	Prova P2
11/jun	2ª	Séries temporais		
13/jun	4ª	Séries temporais		
18/jun	2ª	Recesso - Feriado Municipal		
20/jun	4ª	AD_2,3 Possível Apresentação - Grupos	Séries T.	Trabalho T5
25/jun	2ª	AD_2,3 Possível Apresentação - Grupos		
27/jun	4ª	AD_2,3 Data final para apresentação - Grupos		Análise A_2,3
02/jul	2ª	Revisão de provas, trabalhos, listas		
04/jul	4ª	Prova Substitutiva		Prova Sub

CRITÉRIOS PARA AVALIAÇÃO

A avaliação será feita através de

- duas provas;
- três análises de dados;
- cinco trabalhos;
- 14 listas de exercícios.

A média final (MF) de cada aluno será determinada por

$$MF = 0,5 P + 0,2 A + 0,1 T + 0,2 L$$

Sendo P, A, T e L valores entre zero e dez, dados por:

P = Média aritmética entre a nota obtida na Prova 1 e a nota obtida na Prova 2;

A = Média ponderada obtida em 3 análises de dados, definida por

$$A = 0,2 A_1 + 0,3 A_2 + 0,5 A_3, \text{ sendo } A_i \text{ a Análise de Dados } i;$$

T = Média aritmética obtida em cinco Trabalhos;

L = Média aritmética obtida em 14 Listas.

Provas:

As Provas estão marcadas para as seguintes datas:

P₁: 11 de abril e P₂: 06 de junho.

- Será permitido consulta em material próprio: impresso ou escrito em papel.

- Não é permitido utilizar celular ou *tablet* na prova.

- As provas não serão feitas com auxílio de softwares.

Análise de Dados e Trabalhos:

As análises de dados e trabalhos são definidos no STOA.

As análises de dados (A_i) e os trabalhos (T_i) deverão ser postados no STOA da disciplina em arquivo PowerPoint ou pdf. **Arquivos do tipo Excel serão desconsiderados (receberão nota igual a zero).**

- A nota máxima em cada Análise de Dados ou Trabalho é 10,0 (dez).

- Quem não entregar no dia agendado poderá fazer posteriormente, até 4/Jul. Neste caso (entrega em atraso) a nota máxima em cada Análise de Dados ou Trabalho será 5,0 (cinco).

Listas de exercícios:

- Cada Lista de exercícios, tem a nota máxima igual a 10,0.

- As Listas (respostas) deverão ser entregues no site STOA da disciplina nos dias apontados no cronograma até o horário estipulado no site STOA da disciplina, ou então até o final da aula do dia indicado no Cronograma.

- A nota máxima para Listas entregues fora do prazo é igual a 5,0. O controle do atraso é feito com base no registro de entrega no STOA da disciplina.

Controle de frequência:

O controle de frequência será feito em cada aula, na forma de chamada registrando falta em planilha Excel, ou com assinatura. O controle parcial será apresentado a cada aula em planilha Excel. A frequência final será igual ao número de presenças dividido pelo número total de dias de aula. Para este semestre de 2018 o número de dias de aula é igual a 34. Atingindo 11 faltas a frequência final resulta em 65,625%.

O número máximo de faltas permitido neste semestre é igual a 10 (dez faltas).

O número máximo individual de faltas até o final do semestre será atualizado a cada chamada e apresentado em cada aula, em planilha Excel. O aluno que preferir que suas informações de frequências não sejam apresentadas durante a chamada deve fazer esta solicitação por e-mail.

Atenção: Atestado médico não remove faltas. Por favor, procure a secretaria de graduação para informações sobre esta questão.

BIBLIOGRAFIA

Nesta disciplina serão utilizados materiais contidos nos seguintes livros:

●● LEVINE, David M.; STEPHAN, David F.; KREHBIEL, Timothy C.; BERENSON, Mark L. *Estatística: Teoria e aplicações usando Microsoft® Excel em português*, 6ª ed. Rio de Janeiro: LTC, 2012.

● TRIOLA, M.F. *Introdução à Estatística*, 10ª ed. Rio de Janeiro: LTC, 2008.

MALHOTRA, N. K., *Pesquisa de Marketing*, 3ª ed., Bookman

STEVENSON, W. J. *Estatística Aplicada à Administração*. São Paulo: Harbra, 1986.

ANDERSON, D. R.; SWEENEY, D. J. ; WILLIAMS, T. A. *Estatística Aplicada à Administração e Economia*. 2ª ed. São Paulo: Cengage Learning, 2007.

CORRAR, L. J.; Paulo, E.; Dias Filho, J. M.; *Análise Multivariada - Para os cursos de Administração, Ciências Contábeis e Economia*, 1ª ed., Atlas, 2007.

FÁVERO, Luiz P.; BELFIORE, Patrícia; DA SILVA, Fabiana L.; CHAN, Betty L. *Análise de Dados: Modelagem multivariada para tomada de decisões*, Rio de Janeiro: Elsevier, 2009.

JOHNSON, Richard A.; WICHERN, Dean W. *Applied Multivariate Statistical Analysis*, 5th Ed. London, 2002.

MATERIAL PARA ESTUDO

Os slides e demais arquivos apresentados nas aulas serão disponibilizados no site STOA. A seguir são informados os capítulos e páginas dos principais livros da bibliografia relacionados ao conteúdo ministrado nas aulas. A referência para **capítulo é feita em negrito**. Alguns tópicos específicos poderão ser encontrados apenas nos slides de aula ou no resumo da disciplina, estes casos estão indicados por "Slides/Resumo".

Conteúdo	ANDERSON	STEVENSON	LEVINE	TRIOLA
Revisão	1-8	1-8	1-8	1-7
Teste de Hipótese (TH) - uma amostra	9, 309-351	9-10, 231-240	9	8, 304-359
TH - duas amostras	10, 353-372	10, 240-250	10	9, 360-407
TH - várias amostras: ANOVA	10, 372-397	11	11	12
Teste de Hipótese: Revisão	9-10	9-11	9-11	8, 9 e 12
Prova 1 (Listas 1-7, Resumo)	9-10	9-11	9-11	8, 9 e 12
Covariância e Correlação (Pearson)	3, 98-106	14, 367-382	13, 480-533	10, 408-428
Matriz de covariância e de correlação	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo
Risco de uma carteira	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo
Regressão linear simples	12	14, 341-365	13	10, 429-449
Modelo CAPM	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo	Slides/Resumo
Regressão linear múltipla	13	14, 365-367	14	10, 450-467
Prova 2 (Listas 8-14, Resumo)	3, 12 e 13	14	13-14	10

No caso de prova substitutiva o conteúdo será:

Teste de Hipótese, Covariância, Correlação, Regressão Linear Simples