



Prof. Estevam Martins
stvm@uol.com.br

ANOVA é uma coleção de modelos estatísticos no qual a variância amostral é particionada em diversos componentes devido a diferentes fatores (variáveis), que nas aplicações estão associados a um processo, produto ou serviço. Através desta partição, a ANOVA estuda a influência destes fatores na característica de interesse. No estudo destas influências, alguns autores como Eisenhart (1947), perceberam que havia, na verdade, dois tipos fundamentalmente diferentes de efeitos que os chamou de efeitos fixos e efeitos aleatórios. Neste módulo, vamos apresentar os modelos associados a técnica da ANOVA para ambos tipos de efeitos.

Consideremos o retorno diário de um portfólio e o retorno do índice S&P 500 analisados no período de 12 meses. Queremos analisar esses retornos ao longo desses 12 períodos.

- Propor um modelo paramétrico.
- Propor a estratégia de intervalo de confiança e de teste de hipótese.
- Estimar parâmetros do modelo.
- Analisar de resíduos.