

CURSO: Graduação em Economia – 1º semestre de 2021
DISCIPLINA: Teoria da Probabilidade
PROFESSOR(ES): Paulo Cezar Pinto Carvalho
CARGA HORÁRIA: 90h
PRÉ-REQUISITO: Cálculo II
HORÁRIO E SALA DE ATENDIMENTO: Segunda-feira, 14:00-16:00
SALA: 519

PLANO DE ENSINO

1. Ementa

Eventos e espaços amostrais. Independência, probabilidades condicionais e espaços produto. Variável aleatória. Variáveis aleatórias discretas (Bernoulli, binomial, Poisson, geométrica e hipergeométrica) e contínuas (uniforme, exponencial, gama, normal). Esperança e variância. Covariância e correlação. Processo de Poisson. Probabilidade condicional, esperança condicional. Sequências de variáveis aleatórias: noção, conceitos de convergência. Leis dos Grandes Números: conceito, a lei fraca, a lei forte; aplicações. Teoria Central do Limite – situação do problema; Teorema Central do Limite; aplicações. Distribuições amostrais (t, qui-quadrado e F). Introdução à Inferência Estatística.

2. Objetivos da disciplina

O objetivo do curso é apresentar aos alunos a teoria da probabilidade, entendida como a disciplina matemática que propõe uma abordagem para o estudo dos fenômenos aleatórios. O curso pretende desenvolver nos alunos tanto a intuição como o ferramental matemático apropriado para lidar com situações envolvendo modelos probabilísticos. É também objetivo do curso propiciar uma preparação para estudos futuros em métodos estatísticos e modelos estocásticos em geral.

3. Objetivos centrais de aprendizagem

Ao final do curso, espera-se que o(a) aluno(a) seja capaz de compreender e utilizar modelos probabilísticos. Além disso, o curso fornecerá o conhecimento apropriado para cursos em Estatística.

4. Relação da disciplina com o debate contemporâneo

A natureza estocástica é essencial ao estudo de fenômenos e comportamentos no universo humano-social. O curso fornecerá a base para o entendimento destes processos.

5. Procedimentos de ensino (metodologia)

O curso será baseado em aulas expositivas e na resolução de listas de exercícios.

6. Conteúdo programático detalhado

Semana	Conteúdos
8/2 a 12/2	Eventos e espaços amostrais. Espaços equiprováveis. Probabilidade Condicional. Teorema de Bayes
19/2	Exercícios
22/2 a 26/2	Variáveis Aleatórias Discretas. Função de Probabilidade e Função de Probabilidade Acumulada. Valor esperado e variância.
1/3 a 5/3	Função de Probabilidade Conjunta. Distribuição Marginal e Condicional. Funções de variáveis aleatórias. Covariância e Correlação.
8/3 a 12/3	Distribuição de Bernoulli e Binomial. Distribuição Geométrica e Hipergeométrica.
15/3 a 19/3	Distribuição de Poisson. Variáveis aleatórias contínuas. Densidade de probabilidade.
22/3 a 26/3	Valor esperado e variância.
29/3 a 31/3	Funções de variáveis aleatórias contínuas
5/4 a 12/4	A1
13/4 a 16/4	Resolução da Prova. Distribuição Uniforme.
19/4	Distribuição Exponencial.
26/4 a 30/4	Distribuição Gama. Distribuição Normal.
3/5 a 7/5	Função taxa de falha.
10/5 a 14/5	Variáveis aleatórias bidimensionais contínuas: densidade conjunta, marginal e condicional. Covariância e correlação.
17/5 a 21/5	Funções de variáveis aleatórias contínuas. Somas e médias de variáveis aleatórias. Desigualdade de Chebyshev e Lei dos Grandes Números.
24/5 a 28/5	Teorema Central do Limite e Aplicações.
31/5 a 2/6	Noções de simulação: geração de variáveis aleatórias discretas e contínuas. Estimadores e suas propriedades.
7/6 a 11/6	Distribuições amostrais: qui-quadrado e t de Student.
14/6	Revisão e exercícios.
16/6 a 22/6	A2

7. Procedimentos de avaliação

Serão realizados dois testes (T1 e T2) e duas provas (P1 e P2).

$$A1 = T1 \times 0,3 + P1 \times 0,7$$

$$A2 = T2 \times 0,3 + P2 \times 0,70$$

Média final = $(A1 + A2) / 2$

Se a média final for menor que 6,0 , será feita a AS para substituir a menor entre as notas A1 e A2.

8. Bibliografia Obrigatória

BUSSAB, W.; MORETTIN, P.. *Estatística Básica: Probabilidade e Inferência*. Pearson, 2010

MAYER, Paul. *Probabilidade: aplicações à Estatística*. Livros Técnicos e Científicos, 1983.

ROSS, Ross. *Probabilidade: um curso moderno, com aplicações*. Artmed, 2010.

9. Bibliografia Complementar

JAMES, Barry R.. *Probabilidade: um curso intermediário*. IMPA, 1996.

BLITZTEIN, J; HWANG, J. *Introduction to Probability*. Chapman & Hall, 2015.

HOGG, R.V.; TANNIS, E. A.. *Probability and statistical inference*. Prentice Hall, 2010.

MORGADO, A. C. et al. *Análise Combinatória e Probabilidade*. SBM, 2001.

TEIXEIRA, Ralph; MORGADO, Augusto César. Notas de Aula.

10. Minicurrículo do(s) Professor(s)

Possui graduação em Engenharia Civil pelo Instituto Militar de Engenharia (1975), mestrado em Matemática pela Associação Instituto Nacional de Matemática Pura e Aplicada (1980) e doutorado em Operations Research - Cornell University (1984). Foi pesquisador da Associação Instituto Nacional de Matemática Pura e Aplicada (IMPA) de 1979 a 2013. Atualmente, é professor da Escola de Matemática Aplicada da Fundação Getúlio Vargas. Seu interesse atual de pesquisa é a aplicação de métodos de inteligência computacional a problemas de diversas áreas, incluindo Visão Computacional, Avaliação Educacional e Modelagem em Esportes.

11. Link para o Currículo Lattes

<http://buscatextual.cnpq.br/buscatextual/visualizacv.do?metodo=apresentar&id=K4721463Y6>