
CURSO: Graduação em Economia – 1º semestre de 2019
DISCIPLINA: Teoria da Probabilidade
PROFESSOR(ES): Paulo Cezar Pinto Carvalho
CARGA HORÁRIA: 90h
PRÉ-REQUISITO: Cálculo I
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, na resolução de listas de exercícios e na elaboração de um projeto computacional.

6. Conteúdo programático detalhado

Semana	Conteúdos
11/2 a 15/2	Eventos e espaços amostrais. Espaços equiprováveis. Probabilidade Condicional. Teorema de Bayes
18/2 a 22/2	Variáveis Aleatórias Discretas. Função de Probabilidade e Função de Probabilidade Acumulada. Valor esperado e variância.
25/2 a 1/3	Função de Probabilidade Conjunta. Distribuição Marginal e Condicional. Funções de variáveis aleatórias. Covariância e Correlação.
11/3 a 15/3	Distribuição de Bernoulli e Binomial. Distribuição Geométrica e Hipergeométrica.
18/3 a 22/3	Distribuição de Poisson. Variáveis aleatórias contínuas. Densidade de probabilidade.
25/3 a 29/3	Valor esperado e variância.
1/4 a 5/4	Funções de variáveis aleatórias contínuas
8/4	Revisão e exercícios.
10/4 a 17/4	A1
24/4 e 26/4	Distribuição Uniforme. Distribuição Exponencial . Distribuição Gama.
29/4 a 3/5	Função taxa de falha. Distribuição Normal.
6/5 a 10/5	Variáveis aleatórias bidimensionais contínuas: densidade conjunta, marginal e condicional. Covariância e correlação.
13/5 a 17/5	Funções de variáveis aleatórias contínuas. Somas e médias de variáveis aleatórias. Desigualdade de Chebyshev e Lei dos Grandes Números.
20/5 a 24/5	Teorema Central do Limite e Aplicações.
27/5 a 31/5	Noções de simulação: geração de variáveis aleatórias discretas e contínuas. Estimadores e suas propriedades.
3/6 a 7/6	Distribuições amostrais: qui-quadrado e t de Student.
10/6	Revisão e exercícios.
12/6 a 19/6	A2

7. Procedimentos de avaliação

Serão realizados dois testes, um em cada período, duas provas e um trabalho computacional

T1 = nota do primeiro teste

P1 = nota da primeira prova

T2 = nota do segundo teste

P2 = nota da segunda prova

TC = nota do trabalho computacional

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

$$A2 = T2 \times 0,3 + TC \times 0,1 + P2 \times 0,6$$

$$\text{Média final} = (A1 + A2) / 2$$

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

BARRY, R. James. *Probabilidade: um curso intermediário*. IMPA, 1996.

CHUNG, Kai La; AITSAHLIA, Farid. *Elementary probability theory: with stochastic processes and an introduction to mathematical finance*. Springer, 2003.

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>