

**U.C. 21037**

**Elementos de Probabilidade e Estatística**

**21 de Junho de 2011**

**Critérios de correção e orientações de resposta – p-fólio**

Neste relatório apresentam-se os critérios e um exemplo de resolução, bem como algumas notas suplementares que pretendem clarificar métodos e indicar sugestões de correção de alguns erros que se observaram nas provas entregues pelos estudantes.

I. Considere a precipitação (em mm) caída no Porto nos anos 1997 a 2007:

| Anos         | 1997  | 1998  | 1999  | 2000 | 2001  | 2002  | 2003  | 2004  | 2005 | 2006 | 2007 |
|--------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|------|------|------|
| Precipitação | 162,5 | 149,1 | 101,7 | 46,8 | 403,4 | 157,5 | 332,2 | 126,8 | 9,6  | 62,3 | 53,3 |

Com base nos dados apresentados, responda às alíneas:

**(2.0 v)** Qual a média, a variância e o coeficiente de variação da precipitação no Porto nos anos em análise? Comente a dispersão que calculou em termos da sua magnitude e indique outras medidas de dispersão que conhece.

**Resolução e critérios:**

Na resolução desta questão devem constar as expressões das medidas de estatística descritiva que são pedidas (de acordo com o que consta nas folhas digitalizadas na pasta Apontamentos-**Dados Estatísticos na página da UC**, ou outras fórmulas que sejam equivalentes); Devem ser indicados pelo menos parte dos cálculos (mesmo que realizados com recurso a calculadora), os resultados e os comentários pedidos.

Média dos  $n=11$  valores de precipitação é dada por

$$\bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i = \frac{1}{11} \sum_{i=1}^{11} x_i = \frac{(162,5 + 149,1 + \dots + 62,3 + 53,3)}{11} = 145,93 \text{ mm}$$

A variância dos dados dá-nos um valor para a dispersão dos dados relativamente ao seu valor médio. Pode ser calculada pelas seguintes expressões equivalentes:

$$s^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 \quad \text{ou} \quad s^2 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i^2 - \bar{x}^2 .$$

Se considerarmos a segunda expressão para fazer os cálculos temos o seguinte:

$$s^2 = \frac{1}{11} \sum_{i=1}^{11} x_i^2 - (145,93)^2 = \frac{(162,5^2 + 149,1^2 + \dots + 62,3^2 + 53,3^2)}{11} - (145,93)^2 = 13428,63$$

Este valor mostra uma variância muito elevada, mas, sendo um valor que resulta de parcelas elevadas quadrado, é extraído a sua raiz quadrada e obtendo o desvio padrão que se poderá ter uma melhor ideia se os dados estão muito ou pouco dispersos em relação à média. O desvio padrão está nas unidades de medida das observações.

O **coeficiente de variação** dá-nos uma medida da dispersão dos dados relativamente à média, em termos percentuais de dispersão.  $C.V. = \frac{s}{\bar{x}}$  (quociente entre o desvio padrão e a média). O C.V. é muito útil para comparar duas ou mais amostras que podem ter diferentes unidades de medida.

$$C.V. = \frac{s}{\bar{x}} = \frac{\sqrt{13428,63}}{145,93} = \frac{115,89}{145,93} = 0,794 = 79,4\%$$

Comentário aos valores obtidos – tendo em conta a amostra inicial, vê-se que há valores bastante díspares e a variabilidade é grande. Isto confirma-se também em relação ao valor médio da precipitação. A variância é elevada, o desvio padrão é de 115,89 mm de precipitação. A percentagem de variabilidade é de 79,4%.

Outras medidas de dispersão que poderiam ser indicadas são a amplitude dos dados,  $A = \text{Max} - \text{Min}$ , e a amplitude inter-quartis.

**Nota1:** Quando se fala em **Variância de uma amostra**, a expressão que se pede é a anterior, denotada por  $S^2$ . O denominador é  $n$ , ou seja, o número total de observações da amostra. Quando é pedida a **Variância Corrigida**, então, o denominador passa a ser  $n-1$ , e indica-se  $S'^2$  (lê-se *S linha ao quadrado*). A variância corrigida é então calculada por

$$s'^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2, \text{ mas também pode ser calculada usando a primeira } s'^2 = \frac{n}{n-1} s^2.$$

Recorde-se que sendo a variância resultante da soma de parcelas elevadas ao quadrado, nunca pode ter um valor negativo. O mesmo acontece obviamente com o desvio padrão.

Na folha de cálculo Microsoft Excel 2007, a função estatística que calcula a variância mais comum  $S^2$ , denota-se por VARP(). A **variância corrigida** é calculada pela instrução/função VAR().

**Nota2:** Alguns alunos confundiram Coeficiente de Variação com coeficiente de Correlação conceito este que é totalmente distinto do primeiro.

O **coeficiente de correlação** é uma medida da intensidade da relação linear entre **duas variáveis**. Este coeficiente varia entre -1 (correlação negativa perfeita) e 1 (correlação positiva perfeita). Se a correlação é zero, então as variáveis não são correlacionadas.

O coeficiente de correlação linear de Pearson, o mais comum, pode ser calculado pela expressão seguinte  $r = \frac{s_{xy}}{s_x s_y} = \frac{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i \times y_i - \bar{x} \times \bar{y}}{s_x s_y}$  ou  $r = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2} \sqrt{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}}$  onde  $S_x$  e  $S_y$  são os desvios padrões de X e de Y respetivamente (Ver tópico 1.8 das folhas na página da U.C., Apontamentos-Dados Estatísticos).

II. Uma peça é manufacturada por 3 fábricas: 1, 2 e 3. Sabe-se que a fábrica 2 produz 2,5 vezes a produção de cada uma das fábricas 1 e 3. Além disso, 3% das peças produzidas pelas fábricas 1 e 3 são defeituosas, enquanto 4 % das produzidas pela fábrica 2 são defeituosas. Todas as peças produzidas são colocadas no mesmo armazém. Tira-se uma peça ao acaso da produção global. Qual a probabilidade:

- a) (1.0 v) De ter sido produzida na fábrica 2?
- b) (1.0 v) Da peça ser defeituosa? (Caso não tenha resolvido a alínea a) considere que é equiprovável a probabilidade da peça ser produzida em qualquer uma das fábricas)

### Resolução e critérios

a) O problema apresentado insere-se no cálculo de probabilidades sobre acontecimentos que ocorrem num universo, incluindo as probabilidades condicionais.

Para ter uma resposta completa, interessa identificar e descrever numa linguagem formal todos os acontecimentos envolvidos, identificar quais as probabilidades que são pedidas nas alíneas do enunciado, apresentar o seu cálculo e os resultado.

O Universo é o universo da produção das peças. O universo é constituído por 3 fábricas  $F_1$ ,  $F_2$  e  $F_3$ .  
Sejam então os acontecimentos

$F_1$  = «A peça é produzida pela fábrica  $F_1$ »

$F_2$  = «A peça é produzida pela fábrica  $F_2$ »

$F_3$  = «A peça é produzida pela fábrica  $F_3$ »

Sendo as 3 fábricas responsáveis pela totalidade da produção (do universo), e assumindo que cada fábrica produz de forma independente das outras, então a soma das probabilidades de produção das 3 fábricas tem de ser igual a 1.  $P(\Omega) = P(F_1) + P(F_2) + P(F_3) = 1$ . ( $\Omega$  representa o universo dos locais de produção das peças)

Do enunciado retira-se o seguinte:  $P(F_2) = 2,5 \times P(F_1)$  e  $P(F_3) = 2,5 \times P(F_1)$ . Daqui se conclui que  $F_2$  e  $F_3$  produzem a mesma percentagem de peças. Então, substituindo na equação inicial e resolvendo tem-se

$$P(F_1) + 2,5 \times P(F_1) + P(F_1) = 1, \text{ donde } 4,5P(F_1) = 1 \Rightarrow P(F_1) = 0,22$$

Daqui tiramos  $P(F_3) = 0,22$  e  $P(F_2) = 2,5 \times 0,22 = 0,56$

Respondendo à pergunta, conclui-se que a probabilidade da peça tirada ao acaso ser proveniente da Fábrica 2 é aproximadamente igual a 0,56.

b) Uma peça pode ser defeituosa a partir de três origens, ou seja a probabilidade de ser defeituosa está condicionada ao local onde foi fabricada. Como à partida não é dito onde foi fabricada, temos de calcular a Probabilidade Total da peça ser defeituosa, ponderando às 3 origens possíveis.

Defina-se o acontecimento D que pode ocorrer no universo das 3 fábricas

$D$  = «Retira-se uma peça defeituosa».

No enunciado estão presentes as seguintes probabilidades condicionadas:

Probabilidade de uma peça ser defeituosa se (condicionada a) for produzida pela Fábrica 1

$P(D|F_1) = 0,03$  (3%). Sabe-se também que  $P(D|F_3) = 0,03$  e que  $P(D|F_2) = 0,04$ .

Pelo teorema das probabilidades totais, a probabilidade total da peça ser defeituosa, ponderada às 3 origens possíveis é:

$$P(D) = P(D|F_1) \times P(F_1) + P(D|F_2) \times P(F_2) + P(D|F_3) \times P(F_3) \\ = 0,03 \times 0,22 + 0,04 \times 0,56 + 0,03 \times 0,22 = 0,0356$$

**Nota:** a resolução desta questão podia recorrer ao conhecido diagrama de probabilidades em árvore e seria aceite essa apresentação, desde que fossem inicialmente definidos os acontecimentos.

III. Considere uma experiência aleatória que consiste no lançamento de dois dados perfeitos (não viciados) distintos e observa-se o número de pintas na face voltada para cima. Definindo a variável aleatória X como o produto dos resultados obtidos nas duas faces, determine:

- (1.0 v)** O espaço de resultados da experiência aleatória do lançamento dos dados.
- (1.0 v)** Os valores possíveis para X e a sua função de probabilidade.
- (1.0 v)** A função distribuição da variável aleatória X.

#### Resolução e critérios

Na resolução das alíneas propostas o estudante deve identificar as variáveis, descrever todos os resultados possíveis do lançamento e os valores possíveis para a variável X, tal como está definida. Devem apresentar todas as expressões que utilizam, as consultadas no formulário e outras de que necessitem.

a) A experiência está definida do seguinte modo: *lançamento de dois dados perfeitos (não viciados) distintos e observa-se o número de pintas na face voltada para cima.*

Chamemos A e B aos dois dados. Então, o espaço de resultados é constituído por todos os pares ordenados  $(a, b)$  possíveis, nos quais  $a$  representa o número de pintas do dados A e  $b$  representa o número de pintas do dado B.  $a$  e  $b$  podem variar de 1 até 6, o que dá 36 pares possíveis (porque os dados são distintos).

$\Omega = \{(1,1), (1,2), (1,3), (1,4), (1,5), (1,6), (2, 1), (2,2), (2,3), \dots\dots\dots (6,5), (6,6)\}$ ; ou resumidamente  $\Omega = \{(a,b): a=1,2,3, 4,5,6; b=1,2,3, 4,5,6 \}$ ;

b)  $X$  – Produto dos resultados obtidos nas duas faces

A visualização dos resultados possíveis para  $X$  é simplificada se colocarmos as possibilidades num quadro de dupla entrada. No interior grelha estão todos os produtos possíveis. (são aceites em exame apresentações igualmente corretas)

| Face do Dado A<br>Face do Dado B | 1 | 2  | 3  | 4  | 5  | 6  |
|----------------------------------|---|----|----|----|----|----|
| 1                                | 1 | 2  | 3  | 4  | 5  | 6  |
| 2                                | 2 | 4  | 6  | 8  | 10 | 12 |
| 3                                | 3 | 6  | 9  | 12 | 15 | 18 |
| 4                                | 4 | 8  | 12 | 16 | 20 | 24 |
| 5                                | 5 | 10 | 15 | 20 | 25 | 30 |
| 6                                | 6 | 12 | 18 | 24 | 30 | 36 |

A função de probabilidade consiste em atribuir a cada valor de  $X$  a sua probabilidade de ocorrência. Assumimos que os dados são não viciados e os lançamentos **independentes**. Assim, é possível calcular a probabilidade como (número de casos favoráveis/todos os casos possíveis). Por exemplo, a probabilidade de  $X$  tomar o valor 12 é igual a  $4/36$ . A probabilidade de  $X$  tomar o valor 10 é igual a  $2/36$ .

A função de probabilidade pode ser resumida da seguinte forma:

$$f(x) = P(X = x_i) = \begin{cases} \frac{1}{36}, & \text{para } x = 1, 9, 16, 25, 36 \\ \frac{2}{36}, & \text{para } x = 2, 3, 5, 8, 10, 15, 18, 20, 24, 30 \\ \frac{3}{36}, & \text{para } x = 4 \\ \frac{4}{36}, & \text{para } x = 6, 12 \end{cases}$$

c) Sendo  $X$  uma variável aleatória discreta (toma valores em pontos e não num intervalo de números reais), a função distribuição tem a expressão  $F_X(x) = \sum_{x_i \leq x} f_X(x_i)$ . É portanto uma função

cumulativa de probabilidades. Para cada  $x_i$  do domínio da variável  $X$ , atribui-se a probabilidade de  $X$  ser menor ou igual que esse  $x_i$ . Relembremos que o domínio de  $X$  são todos produtos, ou seja  $\{1, 2, 3, 4, 5, 6, 8, 9, 10, 12, 15, 16, 18, 20, 24, 25, 30, 36\}$ . Apresentando os cálculos na forma mais detalhada temos o seguinte quadro da função distribuição de  $X$ :

|                                |         |                |                           |   |   |  |  |  |  |
|--------------------------------|---------|----------------|---------------------------|---|---|--|--|--|--|
| (todos os valores de X), $x_i$ | $X < 1$ | $1 \leq X < 2$ | $2 \leq X < 3$            | $3 \leq X < 4$                          | $4 \leq X < 5$                          | $5 \leq X < 6$                           | $6 \leq X < 8$                             | $8 \leq X < 9$                             | $9 \leq X < 10$                            |
| $F(x)=P(X \leq x_i)$           | 0       | 1/36           | 1/36 +<br>P(X=2)<br>=3/36 | 3/36 +<br>P(X=3)<br>=3/36+2/36<br>=5/36 | 5/36 +<br>P(X=4)<br>=5/36+3/36<br>=8/36 | 8/36 +<br>P(X=5)<br>=8/36+2/36<br>=10/36 | 10/36 +<br>P(X=6)<br>=10/36+4/36<br>=14/36 | 14/36 +<br>P(X=8)<br>=14/36+2/36<br>=16/36 | 16/36 +<br>P(X=9)<br>=16/36+1/36<br>=17/36 |

Continuação

|                 |   |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|-----------------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| $x_i$           | $10 \leq X < 12$                            | $12 \leq X < 15$                            | $15 \leq X < 16$                            | $16 \leq X < 18$                            | $18 \leq X < 20$                            | $20 \leq X < 24$                            | $24 \leq X < 25$                            | $25 \leq X < 30$                            | $30 \leq X < 36$                            | $X \geq 36$                                   |
| $P(X \leq x_i)$ | 17/36 +<br>P(X=10)<br>=17/36+2/36<br>=19/36 | 19/36 +<br>P(X=12)<br>=19/36+4/36<br>=23/36 | 23/36 +<br>P(X=15)<br>=23/36+2/36<br>=25/36 | 25/36 +<br>P(X=16)<br>=25/36+1/36<br>=26/36 | 26/36 +<br>P(X=18)<br>=26/36+2/36<br>=28/36 | 28/36 +<br>P(X=20)<br>=28/36+2/36<br>=30/36 | 28/36 +<br>P(X=24)<br>=30/36+2/36<br>=32/36 | 32/36 +<br>P(X=25)<br>=32/36+1/36<br>=33/36 | 33/36 +<br>P(X=30)<br>=33/36+2/36<br>=35/36 | 35/36 +<br>P(X=36)<br>=35/36+1/36<br>=36/36=1 |

**Nota:** a leitura do quadro faz-se do seguinte modo: a probabilidade de o produto, X, tomar valores inferiores a 14 (ou à esquerda de 14) é igual a 23/36. O intervalo assinalado a amarelo no quadro  $12 \leq X < 15$ , significa que X pode tomar todos os valores nesse intervalo, exceptuando 15, por ser aberto à direita.

**IV.** Uma empresa dispõe de uma caixa multibanco para utilização dos seus funcionários, depois de muitas observações concluiu-se que o número de utilizações da caixa multibanco segue um processo de Poisson. Em média, por hora, 8 pessoas utilizam os serviços da caixa multibanco. Calcule a probabilidade de:

- (1.0 v)** Numa hora escolhida aleatoriamente, não ter havido mais do que uma pessoa a utilizar a máquina.
- (1.0 v)** Numa hora, escolhida aleatoriamente, a máquina ter sido utilizada no mínimo por 7 pessoas.

#### Resolução e critérios

Na resolução desta questão os estudantes devem definir a variável aleatória em causa, identificar o parâmetro da distribuição de Poisson para este caso, definir os acontecimentos envolvidos em cada alínea indicar os cálculos necessários e apresentar os resultados.

a) Comece-se por descrever formalmente a variável presente no enunciado

X – Número de utilizações da caixa Multibanco (caixa ATM) por hora(60 minutos).

Sabe-se que em média há 8 pessoas por hora que levantam dinheiro na caixa multibanco da empresa, então, a variável X segue uma distribuição de Poisson com valor médio igual a 8. Sendo o parâmetro  $\lambda$  igual ao valor médio, tem-se

$$X \sim \text{Poisson} (\lambda = 8) \text{ ou, resumidamente } X \sim P (\lambda = 8).$$

Pede-se nesta alínea a probabilidade de não haver mais de 1 pessoa a utilizar a máquina numa hora escolhida ao acaso. Não haver mais do que uma é equivalente a dizer que a caixa é utilizada por zero pessoas ou por uma pessoa, no máximo.

$$P(X \leq 1) = P(X = 0) + P(X = 1) = \frac{8^0 e^{-8}}{0!} + \frac{8^1 e^{-8}}{1!} = 0,003$$

b) Nesta alínea pede-se a probabilidade, numa hora escolhida ao acaso, a máquina ter sido utilizada no mínimo por 7 pessoas. No mínimo 7 significa que poderão ser 7, 8, 9, 10, 11, 12.... Por não haver limite máximo, é mais fácil calcular a probabilidade usando o inverso.

$$P(X \geq 7) = 1 - [P(X \leq 6)] = 1 - \left[ e^{-8} \times \left( \frac{8^0}{0!} + \frac{8^1}{1!} + \frac{8^2}{2!} + \frac{8^3}{3!} + \frac{8^4}{4!} + \frac{8^5}{5!} + \frac{8^6}{6!} \right) \right]$$

**Nota.** Por definição o fatorial de zero, 0!, é 1. O fatorial de qualquer número inteiro n é representado por n! e é determinado por n! = n × (n-1) × (n-2) × ... × 1. Por exemplo, o fatorial de 5 calcula-se por - 5! = 5 × 4 × 3 × 2 × 1 = 120. (uma calculadora científica tem uma função que indica o fatorial de qualquer número inteiro, e geralmente está numa tecla assinalada por x!)

- V.** Os resultados numa prova de corrida de determinada modalidade são normalmente distribuídos com uma média de 35 segundos e um desvio padrão de 6 segundos. Qual a probabilidade de numa prova seleccionada aleatoriamente obter resultados:
- (1.0 v)** Superiores a 32s? (faça o esboço gráfico)
  - (1.0 v)** Entre os 30s e os 37s? (faça o esboço gráfico)
  - (1.0 v)** De no final da primeira volta, correspondente a quinze provas de corrida, a média dos resultados ser inferior a 34 s?

### Resolução e critérios

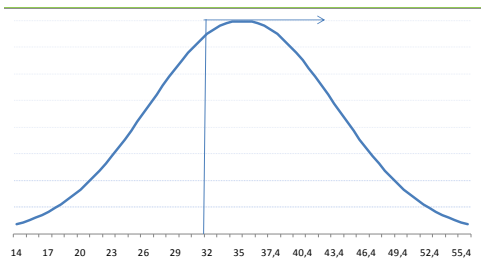
Esta questão envolve principalmente o conhecimento da lei de distribuição Normal, os seus parâmetros  $\mu$  e  $\sigma$  e o cálculo das probabilidades deste tipo de variável com recurso à standardização (variável reduzida) e à consulta da tabela. É aceite uma resolução equivalente à que se segue.

a) Sendo X – Tempo de duração da corrida realizado pelo atleta, em segundos.

$X \sim N(\mu=35; \sigma=6)$ .

Pede-se a probabilidade  $P(X > 32)$ , probabilidade correspondente à área da curva que fica à direita de 32. Sabe-se que não é fácil determinar analiticamente esta probabilidade mas o cálculo é facilitado usando a variável Normal reduzida é dada por  $Z = \frac{X - \mu}{\sigma} \sim N(\mu=0, \sigma^2=1)$  e que tem a função

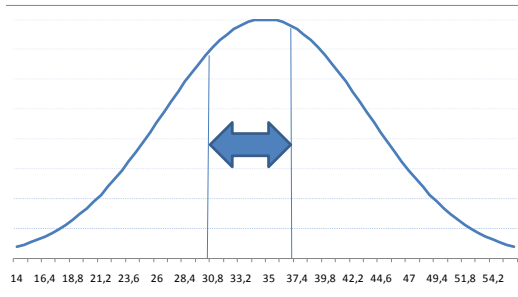
distribuição tabelada. Sabemos também que a tabela fornece probabilidades acumuladas à esquerda de um Z, por isso é conveniente utilizar a probabilidade complementar (probabilidade à direita de z = 1-probabilidade à esquerda de z).



$$\begin{aligned}
 P(X > 32) &= 1 - P(X \leq 32) \stackrel{\substack{\text{standardizando} \\ \text{em ambos lados}}}{=} 1 - P\left(\frac{X - 35}{6} < \frac{32 - 35}{6}\right) = \\
 &= 1 - P(Z < -0,5) = 1 - \underbrace{\Phi(-0,5)}_{\substack{\text{valor tabelado} \\ \text{para } z = -0,5}} = 1 - 0,309 = 0,691
 \end{aligned}$$

| z    | 0     | 1     |
|------|-------|-------|
| -0,6 | 0,274 | 0,271 |
| -0,5 | 0,309 | 0,305 |
| -0,4 | 0,345 | 0,341 |

b) Nesta alínea pede-se a probabilidade de um intervalo,  $P(30 < X < 37)$ . Sabemos da teoria das probabilidades que  $P(a < X < b) = F(b) - F(a)$ , onde F() representa Função de distribuição (acumulada). No caso da distribuição Normal reduzida, a notação é  $P(a < X < b) = \Phi(b) - \Phi(a)$ . Utilizando novamente o raciocínio da alínea anterior, tem-se:



$$\begin{aligned}
 P(30 < X < 37) &= P\left(\frac{30-35}{6} < Z < \frac{37-35}{6}\right) = \\
 &= P(-0,83 < Z < 0,33) = \Phi(0,33) - \Phi(-0,83) = \\
 &= 0,629 - 0,203 = 0,426
 \end{aligned}$$

| z    | 0     | 1     | 2     | 3     |
|------|-------|-------|-------|-------|
| -2,0 | 0,023 | 0,022 | 0,022 | 0,021 |
| ...  | ...   | ...   | ...   | ...   |
| -0,8 | 0,212 | 0,209 | 0,206 | 0,203 |
| ...  | ...   | ...   | ...   | ...   |
| 0,3  | 0,618 | 0,622 | 0,626 | 0,629 |

c) Nesta alínea pede-se a probabilidade para uma média de um conjunto de 15 provas. **Não é** pedida uma probabilidade para X, o tempo de **uma prova** de corrida.

A média de 15 provas também é uma variável aleatória (porque para cada amostra de provas temos uma média de tempos, logo a média é variável). Defina-se então

$\bar{X}$  = "Tempo médio de corrida relativo, a 15 provas realizadas"

Sendo a média de tempos de prova que seguem cada um uma distribuição normal; sendo as provas de corrida independentes; a média  $\bar{X}$  das 15 provas também tem distribuição normal, e sabe-se que os parâmetros são os seguintes:  $X \rightarrow N(\mu; \sigma^2) \Rightarrow \bar{X} \rightarrow N\left(\mu; \frac{\sigma^2}{n}\right)$

Então, para  $n=15$ ,  $\mu_{\bar{X}} = 35$  segundos e a variância é  $\sigma_{\bar{X}}^2 = 6^2 / 15 = 36 / 15 = 2,4$ , o que quer dizer que o desvio padrão é  $\sigma_{\bar{X}} = \sqrt{2,4} = 1,549$

$$P(\bar{X} < 34) = P\left(Z < \frac{34-35}{1,549}\right) = P(Z < -0,646) \approx \Phi(-0,65) = 0,258$$

## ANEXO A

| Modelos         | Expressão das funções de Probabilidade                          | $\mu$           | $\sigma^2$  |
|-----------------|---|-----------------|---|
| Bernoulli       | $P(X = x) = p^x(1-p)^{1-x}$<br>$x=0,1$                          | $p$             | $p(1-p)$  |
| Binomial        | $P(X = x) = \binom{n}{x} p^x (1-p)^{n-x}$<br>$x=0,1,\dots,n$    | $np$            | $np(1-p)$   |
| Poisson         | $P(X = x) = \frac{\lambda^x e^{-\lambda}}{x!}$ $x=0,1,\dots$    | $\lambda$       | $\lambda$   |
| Uniforme        | $P(X = x) = \frac{1}{n}$ $x=0,1,\dots$                          | $\frac{n+1}{2}$ | $\frac{n^2-1}{12}$  |
| Geométrica      | $P(X = x) = p(1-p)^{x-1}; x=1,\dots$                            | $\frac{1}{p}$   | $\frac{1-p}{p^2}$   |
| Hipergeométrica | $P(X = x) = \frac{\binom{M}{x} \binom{N-M}{n-x}}{\binom{N}{n}}$ | $n \frac{M}{N}$ | $n \frac{M}{N} \cdot \frac{N-M}{N} \cdot \frac{N-n}{N-1}$ |

|             |   | Expressão das funções de:               |                     | $\mu$                 | $\sigma^2$ |
|-------------|---|---|---------------------|-----------------------|------------|
| Modelos     | Densidade   | Distribuição                            |                     |                       |            |
| Exponencial | $f(x) = \lambda \exp(-\lambda x)$ $x > 0$   | $F(x) = 1 - \exp(-\lambda x)$ $x > 0$   | $\frac{1}{\lambda}$ | $\frac{1}{\lambda^2}$ |            |
| Uniforme    | $f(x) = \frac{1}{b-a}$ $x \in [a, b]$   | $F(x) = \frac{x-a}{b-a}$ $x \in [a, b]$ | $\frac{a+b}{2}$     | $\frac{(b-a)^2}{12}$  |            |
| Normal      | $f(x) = \frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}} \exp\left[-\frac{1}{2}\left(\frac{x-\mu}{\sigma}\right)^2\right]$ |   | $\mu$               | $\sigma^2$            |            |



**Anexo A - Valores da Função Distribuição Normal Reduzida**

$$\Phi(z) = \int_{-\infty}^z \frac{1}{\sqrt{2\pi}} e^{-u^2/2} du = P(Z \leq z)$$

| <b>z</b>    | <b>0</b> | <b>1</b> | <b>2</b> | <b>3</b> | <b>4</b> | <b>5</b> | <b>6</b> | <b>7</b> | <b>8</b> | <b>9</b> |
|-------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| <b>-2,0</b> | 0,023    | 0,022    | 0,022    | 0,021    | 0,021    | 0,020    | 0,020    | 0,019    | 0,019    | 0,018    |
| <b>-1,9</b> | 0,029    | 0,028    | 0,027    | 0,027    | 0,026    | 0,026    | 0,025    | 0,024    | 0,024    | 0,023    |
| <b>-1,8</b> | 0,036    | 0,035    | 0,034    | 0,034    | 0,033    | 0,032    | 0,031    | 0,031    | 0,030    | 0,029    |
| <b>-1,7</b> | 0,045    | 0,044    | 0,043    | 0,042    | 0,041    | 0,040    | 0,039    | 0,038    | 0,038    | 0,037    |
| <b>-1,6</b> | 0,055    | 0,054    | 0,053    | 0,052    | 0,051    | 0,049    | 0,048    | 0,047    | 0,046    | 0,046    |
| <b>-1,5</b> | 0,067    | 0,066    | 0,064    | 0,063    | 0,062    | 0,061    | 0,059    | 0,058    | 0,057    | 0,056    |
| <b>-1,4</b> | 0,081    | 0,079    | 0,078    | 0,076    | 0,075    | 0,074    | 0,072    | 0,071    | 0,069    | 0,068    |
| <b>-1,3</b> | 0,097    | 0,095    | 0,093    | 0,092    | 0,090    | 0,089    | 0,087    | 0,085    | 0,084    | 0,082    |
| <b>-1,2</b> | 0,115    | 0,113    | 0,111    | 0,109    | 0,107    | 0,106    | 0,104    | 0,102    | 0,100    | 0,099    |
| <b>-1,1</b> | 0,136    | 0,134    | 0,131    | 0,129    | 0,127    | 0,125    | 0,123    | 0,121    | 0,119    | 0,117    |
| <b>-1,0</b> | 0,159    | 0,156    | 0,154    | 0,152    | 0,149    | 0,147    | 0,145    | 0,142    | 0,140    | 0,138    |
| <b>-0,9</b> | 0,184    | 0,181    | 0,179    | 0,176    | 0,174    | 0,171    | 0,169    | 0,166    | 0,164    | 0,161    |
| <b>-0,8</b> | 0,212    | 0,209    | 0,206    | 0,203    | 0,200    | 0,198    | 0,195    | 0,192    | 0,189    | 0,187    |
| <b>-0,7</b> | 0,242    | 0,239    | 0,236    | 0,233    | 0,230    | 0,227    | 0,224    | 0,221    | 0,218    | 0,215    |
| <b>-0,6</b> | 0,274    | 0,271    | 0,268    | 0,264    | 0,261    | 0,258    | 0,255    | 0,251    | 0,248    | 0,245    |
| <b>-0,5</b> | 0,309    | 0,305    | 0,302    | 0,298    | 0,295    | 0,291    | 0,288    | 0,284    | 0,281    | 0,278    |
| <b>-0,4</b> | 0,345    | 0,341    | 0,337    | 0,334    | 0,330    | 0,326    | 0,323    | 0,319    | 0,316    | 0,312    |
| <b>-0,3</b> | 0,382    | 0,378    | 0,374    | 0,371    | 0,367    | 0,363    | 0,359    | 0,356    | 0,352    | 0,348    |
| <b>-0,2</b> | 0,421    | 0,417    | 0,413    | 0,409    | 0,405    | 0,401    | 0,397    | 0,394    | 0,390    | 0,386    |
| <b>-0,1</b> | 0,460    | 0,456    | 0,452    | 0,448    | 0,444    | 0,440    | 0,436    | 0,433    | 0,429    | 0,425    |
| <b>-0,0</b> | 0,500    | 0,496    | 0,492    | 0,488    | 0,484    | 0,480    | 0,476    | 0,472    | 0,468    | 0,464    |
| <b>0,0</b>  | 0,500    | 0,504    | 0,508    | 0,512    | 0,516    | 0,520    | 0,524    | 0,528    | 0,532    | 0,536    |
| <b>0,1</b>  | 0,540    | 0,544    | 0,548    | 0,552    | 0,556    | 0,560    | 0,564    | 0,567    | 0,571    | 0,575    |
| <b>0,2</b>  | 0,579    | 0,583    | 0,587    | 0,591    | 0,595    | 0,599    | 0,603    | 0,606    | 0,610    | 0,614    |
| <b>0,3</b>  | 0,618    | 0,622    | 0,626    | 0,629    | 0,633    | 0,637    | 0,641    | 0,644    | 0,648    | 0,652    |
| <b>0,4</b>  | 0,655    | 0,659    | 0,663    | 0,666    | 0,670    | 0,674    | 0,677    | 0,681    | 0,684    | 0,688    |
| <b>0,5</b>  | 0,691    | 0,695    | 0,698    | 0,702    | 0,705    | 0,709    | 0,712    | 0,716    | 0,719    | 0,722    |
| <b>0,6</b>  | 0,726    | 0,729    | 0,732    | 0,736    | 0,739    | 0,742    | 0,745    | 0,749    | 0,752    | 0,755    |
| <b>0,7</b>  | 0,758    | 0,761    | 0,764    | 0,767    | 0,770    | 0,773    | 0,776    | 0,779    | 0,782    | 0,785    |
| <b>0,8</b>  | 0,788    | 0,791    | 0,794    | 0,797    | 0,800    | 0,802    | 0,805    | 0,808    | 0,811    | 0,813    |
| <b>0,9</b>  | 0,816    | 0,819    | 0,821    | 0,824    | 0,826    | 0,829    | 0,831    | 0,834    | 0,836    | 0,839    |
| <b>1,0</b>  | 0,841    | 0,844    | 0,846    | 0,848    | 0,851    | 0,853    | 0,855    | 0,858    | 0,860    | 0,862    |
| <b>1,1</b>  | 0,864    | 0,867    | 0,869    | 0,871    | 0,873    | 0,875    | 0,877    | 0,879    | 0,881    | 0,883    |
| <b>1,2</b>  | 0,885    | 0,887    | 0,889    | 0,891    | 0,893    | 0,894    | 0,896    | 0,898    | 0,900    | 0,901    |
| <b>1,3</b>  | 0,903    | 0,905    | 0,907    | 0,908    | 0,910    | 0,911    | 0,913    | 0,915    | 0,916    | 0,918    |
| <b>1,4</b>  | 0,919    | 0,921    | 0,922    | 0,924    | 0,925    | 0,926    | 0,928    | 0,929    | 0,931    | 0,932    |
| <b>1,5</b>  | 0,933    | 0,934    | 0,936    | 0,937    | 0,938    | 0,939    | 0,941    | 0,942    | 0,943    | 0,944    |
| <b>1,6</b>  | 0,945    | 0,946    | 0,947    | 0,948    | 0,950    | 0,951    | 0,952    | 0,953    | 0,954    | 0,954    |
| <b>1,7</b>  | 0,955    | 0,956    | 0,957    | 0,958    | 0,959    | 0,960    | 0,961    | 0,962    | 0,962    | 0,963    |
| <b>1,8</b>  | 0,964    | 0,965    | 0,966    | 0,966    | 0,967    | 0,968    | 0,969    | 0,969    | 0,970    | 0,971    |
| <b>1,9</b>  | 0,971    | 0,972    | 0,973    | 0,973    | 0,974    | 0,974    | 0,975    | 0,976    | 0,976    | 0,977    |
| <b>2,0</b>  | 0,977    | 0,978    | 0,978    | 0,979    | 0,979    | 0,980    | 0,980    | 0,981    | 0,981    | 0,982    |

**FIM**