

Auxiliar 4: Probabilidades, Árboles y PDE

Martes 25 de Agosto de 2009

Problema 1

Considere el siguiente juego de azar. Se cuenta con un bolillero con N bolillas numeradas de 1 a N . Se extraen, sin reposición, K bolillas ($K < N$). Hay dos posibilidades de apuesta

- Apuesta común: en la cartilla se seleccionan K números entre 1 y N .
- Apuesta especial: en la cartilla se seleccionan $K + 1$ números entre 1 y N .

Cada apuesta común tiene un costo C y mientras que cada apuesta especial tiene un costo $(K + 1) \times C$. Una vez realizado el sorteo, por cada cartilla se pueden recibir los siguientes premios:

- Primer premio: Si se acierta a los K números sorteados se recibe un premio de valor P por cada cartilla.
- Segundo premio: Si se acierta a $K - 1$ de los números sorteados. En el caso de una apuesta simple, se recibe un premio de valor S . Para una apuesta especial, el premio es de valor $m \times S$.

1. ¿Cuál es el valor esperado de una apuesta común?
2. ¿Cuál es el valor esperado de una apuesta especial?
3. Considere que N es suficientemente grande (en relación a K) para que se puedan escoger $K+1$ apuestas simples que no repiten números.
 - (a) Calcule el valor de m que hace que, en valor esperado, sea indiferente realizar una apuesta especial o $K + 1$ apuestas simples que no repiten números.
 - (b) Suponga que m tiene el valor del punto anterior. Si Ud. es adverso al riesgo, ¿qué prefiere, jugar una apuesta especial o $K + 1$ apuestas simples que no repiten números? Justifique intuitivamente.

Problema 2

Un fabricante de alimento para animales está analizando la compra de maíz para el próximo año. Su proveedor nacional habitual le ofrece la alternativa de realizar una compra anticipada (antes de la cosecha) por un total de 10.000 toneladas a 150 millones de pesos o esperar a la cosecha y comprar lo que necesite al precio de mercado del momento.

El precio de mercado esperado depende del resultado de la cosecha (Buena o Mala) y del nivel de demanda (Alta o Baja), como se muestra en la tabla en miles de pesos por tonelada:

	Nivel de demanda	
	Alta	Baja
Cosecha Buena	17	9
Cosecha Mala	20	12

Se ha observado, que el nivel de la demanda por maíz está correlacionado con la demanda por alimentos que enfrenta la empresa lo que influye tanto en los ingresos como en la cantidad de insumos requerida. En un año de demanda Alta, se utilizan completamente las 10 mil toneladas y se estima un beneficio (sin contar el costo

del maíz) de 350 millones de pesos. En un año de demanda Baja, se consumen sólo 8.000 toneladas de maíz para producir un beneficio de 250 millones de pesos. El maíz sobrante, si hay, se pierde.

Con la información que se cuenta actualmente se espera una cosecha Buena con probabilidad 0,6. En caso de una cosecha Buena, se espera que la demanda sea Alta en el 60 % de los casos; mientras que para una temporada de cosecha Mala se espera que la demanda sea Alta en el 70 % de los casos.

1. Plantee y resuelva un árbol de decisiones que le permita determinar si le conviene aceptar el contrato con el proveedor o esperar hasta la cosecha para comprar.

Un analista le ofrece mejor información sobre la cosecha que se espera. Este le propone realizar un estudio que puede tener como resultados Abundante o Escasa. Se sabe que el 80 % de las veces que la cosecha resultó Buena, el analista había indicado Abundante, mientras que en el 70 % de los casos que la cosecha resultó Mala, el analista había indicado Escasa.

2. ¿Cuál es el valor de la información provista por el analista?

Problema 3

Una empresa de transportes cuenta con dos locales y con una flota de N vehículos idénticos para atender las solicitudes de sus clientes. Cada solicitud, cuando es atendida, mantiene ocupado un vehículo por el día completo.

Cada día la empresa enfrenta, en cada local, una demanda incierta, de la cual se conoce la distribución de probabilidades. Se sabe que el día t , el local 1 recibirá exactamente k solicitudes con probabilidad $p_k(t)$, mientras que el local 2 recibirá exactamente k solicitudes con probabilidad $q_t(k)$.

La empresa recibe un ingreso de valor I por cada pedido que puede atender. Cada pedido fuera de su capacidad se pierde. Movilizar un vehículo del local 1 al local 2, de un día para el otro, tiene un costo C_{12} , mientras que trasladar un vehículo del local 2 al 1, tiene un costo C_{21} . Inicialmente todos los vehículos están en el local 1.

Plantee un modelo de programación dinámica estocástica que permita determinar cómo distribuir los vehículos en los locales cada día para un horizonte de T días, de manera de maximizar el beneficio total esperado durante este período.