El Departamento de Estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Meta-Análisis de Riesgo para grandes proyectos de inversión en infraestructura. Los PIDIREGAS en México

impartirá

Manuel Mendoza Ramírez* **(**Ponente)
Departamento de Estadística
Centro de Estadística Aplicada

Tapen Sinha
Departamento de Actuaría
ITAM

RESUMEN

Los grandes proyectos para el desarrollo de infraestructura demandan un volumen de recursos enorme y su viabilidad económica depende circunstancias que, por su naturaleza y sus interdependencias, dan lugar a una estructura para la propagación de la incertidumbre sumamente compleja. En cualquier caso, la rentabilidad no está asegurada y por tanto estas iniciativas son ejemplos de lo que se conoce como proyectos de inversión con riesgo. No obstante la dificultad implícita, existen procedimientos para la evaluación de proyectos de inversión con riesgo que adoptan supuestos que simplifican la tarea y descansan en el empleo de modelos económicos, financieros y estadísticos de las fuentes de incertidumbre ms relevantes. Con estos procedimientos, que tienen un costo muy elevado, se decide la ejecución de los proyectos. La importancia de este tipo de iniciativas, sin embargo, justifica ese costo.

Una situación completamente distinta se enfrenta cuando una organización emprende la tarea de evaluar una gran cantidad de proyectos de esta clase, de diversa naturaleza y con severas restricciones de tiempo, recursos económicos y personal especializado. El Análisis tiene que ser homogéneo y desarrollarse con menor nivel de detalle. En este seminario se presentar una primera versión de un sistema, muy simple, para la evaluación de proyectos en esas condiciones. Esta versión, que no utiliza explícitamente ningún modelo estadístico, ya ha sido adoptada por una institución pública para el desarrollo de sus funciones. Como parte de la Presentación, se comentarán algunas ideas sobre la asignación subjetiva de probabilidades y la simulación de distribuciones conjuntas que, podrán ser incorporadas en una segunda versión del sistema.

Fecha: Viernes 11 de Octubre
Hora: 12:30
Salón: Sala de Video I Biblioteca, 2. Piso

Lista de seminarios próximos. Visite:

www.stat.itam.mx/Seminarios/Proximos.html

El Seminario Aleatorio está destinado tanto a profesores como a estudiantes, por lo que el Departamento de Estadística agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.