

Задача по корпоративным финансам с решением

Задача. Определить величины риска изучения и риска действия, а также совокупную величину риска инвестирования средств в одном из двух регионов, выбрав при этом наиболее приемлемый из них, руководствуясь следующими данными:

C_1, C_2 - предполагаемая стоимость строительства соответственно в первом и во втором регионах, млн. руб.;

P_{11}, P_{12} - вероятность наступления стихийных бедствий соответственно в первом и во втором регионах;

Y_1, Y_2 - предполагаемая степень ущерба в случае наступления стихийных бедствий соответственно в первом и во втором регионах, %;

P_{21}, P_{22} — вероятность перепрофилирования объекта соответственно в первом и во втором регионах;

D_1, D_2 - доля затрат на перепрофилирование по отношению к предполагаемой стоимости строительства соответственно для первого и для второго регионов, %.

Показатели					
P_{21}	P_{22}	P_{11}	P_{12}	Y_1	Y_2
C_1	C_2	D_1	D_2		
0,55	0,45	0,6	0,45		
65	56	70	90	75	65

Решение:

Риск изучения – потери, вызванные недостаточностью модели управления предприятием. $R_{изуч} = D_i * C_i * P_{изучi}$.

Риск действия – потери, вызванные недостаточностью управления предприятием. $R_{действ} = Y_i * C_i * P_{действi}$.

$$R_{изуч1} = 70 * 65 * 0,6 = 2730 \text{ млн. руб.}$$

Задача скачана с сайта www.MatBuro.ru

Еще примеры: https://www.matburo.ru/ex_econ_all.php?p1=fp

©МатБюро - Решение задач по математике, экономике, статистике

$$R_{\text{изуч}2} = 90 * 56 * 0,45 = 2268 \text{ млн. руб.}$$

$$R_{\text{действ}1} = 75 * 65 * 0,55 = 2681,25 \text{ млн. руб.}$$

$$R_{\text{действ}2} = 65 * 56 * 0,45 = 1638 \text{ млн. руб.}$$

$$\text{Совокупный риск}_1 = 2730 + 2681,25 = 5411,25 \text{ млн. руб.}$$

$$\text{Совокупный риск}_2 = 2268 + 1638 = 3906 \text{ млн. руб.}$$

Наиболее приемлемым будет регион с минимальным совокупным риском, это **второй регион.**