## Практичні завдання

1. Розрахувати систематичний ризик реалізації продукції підприємством порівняно з підприємствами в Україні загалом, використовуючи дані таблиці.

*Таблиця 9.2*

## Обсяги реалізованої продукції підприємством та підприємствами в Україні у 2014-2018 рр., млрд грн

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Показники | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 |
| Загальний обсяг реалізації продукції (послуг)підприємствами України | 737,2 | 987,9 | 1403,1 | 1507,9 | 1600,1 |
| Обсяг реалізованої продукції (послуг)досліджуваним підприємством | 49,4 | 65,2 | 74,4 | 82,9 | 91,4 |

Скористатись прикладом побудови таблиці для оформлення розрахунків відповідно до практичного завдання № 1.

Зробити висновки.

1. Розрахувати систематичний ризик бізнес-клімату в області порівняно з середнім по Україні, використовуючи дані таблиці.

*Таблиця 9.3*

## Чинники негативного впливу на бізнес-клімат в області та в Україні, %

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Проблеми | Україна | Область |
| Недосконалість законодавства | 71,8 | 70,8 |
| Високі ставки податків на соціальне страхування | 68,4 | 69,0 |
| Високий рівень корупції | 66,7 | 70,0 |
| Високі ставки податків на підприємницьку діяльність | 52,1 | 40,0 |
| Неналежний рівень захисту права власності | 47,0 | 35,6 |
| Недостатні внутрішні інвестиції | 30,8 | 25,1 |
| Складність доступу до фінансово-кредитних ресурсів | 30,8 | 52,3 |
| Інше | 6,0 | - |

Розрахунки оформити в таблиці “Розрахунок систематичного ризику бізнес-клімату”.

Зробити висновки.

*Таблиця 9.4*

## Розрахунок систематичного ризику бізнес-клімату

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| Проблема | у | х | у2 | ху |
| Недосконалість законодавства |  |  |  |  |
| Високі ставки податків на соціальне страхування |  |  |  |  |
| Високий рівень корупції |  |  |  |  |
| Високі ставки податків на підприємницьку діяльність |  |  |  |  |
| Неналежний рівень захисту права власності |  |  |  |  |
| Недостатні внутрішні інвестиції |  |  |  |  |
| Складність доступу до фінансово-кредитних ресурсів |  |  |  |  |
| Інше |  |  |  |  |
| Сума |  |  |  |  |
| Середні |  |  |  |  |
| Дисперсія |  |  |  |  |
| Коваріація |  |  |  |  |
| Систематичний ризик |  |  |  |  |

1. Визначити рівень ризику реалізації підприємницького проекту (на перші два роки його функціонування) методом теорії нечітких множин за такими даними: обсяг інвестицій, необхідних для створення підприємства складає 1,5 млн грн; ставка дисконтування в плановому періоді може коливатись від 10 % до 30 % річних; чистий грошовий потік планується в діапазоні від 0 до 3 млн грн.

Зробити висновки.

1. За даними, наведеними в таблиці визначити яка стратегія є оптимальною для підприємства залежно від значень ризику виникнення ситуації при варіантах: № 1 – 40 %, № 2 – 35 %, № 3 – 25 %.

*Таблиця 9.5*

## Експертні оцінки щодо прибутків суб’єкта бізнесу залежно від ситуації на ринку

|  |  |
| --- | --- |
| Товарні групи | Прибуток (тис. грн) при ситуації: |
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | 48 | 67 | 52 |
| 2 | 89 | 24 | 46 |
| 3 | 72 | 49 | 76 |

Зробити висновки.

1. Суб’єктом бізнесу розглядаються інвестиційні проекти А і Б, обсяги інвестицій в які є однаковими. Величина планового доходу відображається розподілом ймовірності, наведеним в таблиці.

*Таблиця 9.6*

## Дохід та розподіл ймовірностей його одержання

|  |  |
| --- | --- |
| Проект А | Проект Б |
| Дохід | Ймовірність | Дохід | Ймовірність |
| 600 | 0,15 | 400 | 0,10 |
| 700 | 0,10 | 600 | 0,25 |
| 800 | 0,40 | 700 | 0,35 |
| 900 | 0,20 | 1000 | 0,20 |
| 950 | 0,15 | 1500 | 0,10 |

Вибрати оптимальний інвестиційний проект. Зробити висновки.

1. За допомогою методу еквівалента певності визначити, чи прийнятний для підприємницького проекту з такими даними:

*Таблиця 9.7*

## Грошовий потік та фактори еквівалента певності

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Роки | Грошовий потік від проекту, тис. грн | Фактор еквівалента певності |
| 1 | 2000 | 0,93 |
| 2 | 3000 | 0,91 |
| 3 | 4000 | 0,80 |
| 4 | 8000 | 0,75 |

Початкові інвестиції – 15000 тис. грн. Доходність державних облігацій – 8 %. Зробити висновки.

## Питання для самостійного вивчення

1. Методика оцінки ризикованості інвестиційних проектів у рамках бізнес-планування.
2. Методика та показники моніторингу зовнішнього середовища функціонування суб’єкта бізнесу як напрям недопущення ризикових ситуацій.
3. Шляхи та заходи щодо мінімізації та профілактики комерційного ризику суб’єкта підприємництва.