

В.В. Верещагин, Р.М. Качалов

В столице Чешской Республики Праге с 19 по 21 октября 2011 г. по инициативе компании MarcusEvans и при поддержке «Русского общества управления рисками» (РусРиск) и Фонда энергетического развития была проведена конференция «Управление рисками в энергетическом секторе России и СНГ», которая собрала представительное сообщество теоретиков и практиков риск-менеджмента из России, Украины, Казахстана, Нидерландов и Чехии. Цель проведения практической конференции была сформулирована организаторами как обмен опытом реализации функции управления риском в крупных компаниях энергетического сектора экономики.

Конференцию открыл Президент и председатель Правления «Русского общества управления рисками» к.и.н. В.В. Верещагин докладом на тему «Развитие риск менеджмента в России». Докладчик остановился на истории становления риск-менеджмента в России, охарактеризовал современное состояние деятельности по управлению риском на российских предприятиях и роль «Русского общества управления рисками» (РусРиск) в распространении современных технологий риск-менеджмента в России.

Общество «РусРиск» было образовано в 2003 году с целью формирования в России рынка услуг и культуры управления риском, соответствующих современному мировому уровню. Учредителями общества выступили Российский союз промышленников и пред-

© Верещагин В.В., Качалов Р.М., 2012 г.

принимателей (РСПП), Национальная фондовая Ассоциация (НФА), Государственная академия специалистов инвестиционной сферы (ГАСИС), НБФ «Экспертный Институт», Московская Ассоциация Страховщиков (МАС). В настоящее время Наблюдательный Совет Общества возглавляет вице-президент РСПП И.Ю. Юргенс.

В.В. Верещагин подчеркнул, что сегодня в состав «РусРиска» входят более 70 корпоративных и индивидуальных членов, а среди его партнеров: ОАО «Северсталь», ОАО «ЛУКОЙЛ», ОАО МТС, ОАО «Рус-Гидро», ИК «РУСС-ИНВЕСТ», ОАО «НТЦ «Промбезопасность-Оренбург», Страховые компании «Росгосстрах», «Ингосстрах», МСК, «Альянс» и «Чартис», Компания «ТИКОМ-Менеджмент», компания «МАРШ-страховые брокеры», ОАО «ИнтерРАО ЕЭС», ОАО «ЭНЕЛ ОГК-5», АФК «Система», Страховые брокеры «Виллис СНГ» и АОН Русс, Финансовая Академия при Правительстве РФ, ЗАО ПМ СОФТ, Адвокатская палата г. Москвы, «Чаадаев, Хейфец и Партнеры», ОАО ЗК «Полюс», НИИГОЧС, РЭА имени Г.В.Плеханова, ЗАО «Индустриальный риск», «Валтарс Риск Менеджмент Лтд.», ОАО «Смоленская чулочная фабрика», компании «American Appraisal», «Мэтьюс Дэниэл Интернэшнл», ЗАО НМЦ «Информатика риска», банки ВТБ, ВЭБ, «Зенит», «Инвестбанк», «УРСА Банк».

Докладчик отметил, что с 2004 г. Общество «РусРиск» представляет Россию в Федерации европейских ассоциаций риск менеджмента (FERMA) и становится активным участником важнейших мероприятий Федерации, в частности, в Лиссабоне (2005 г.), Женеве (2007 г.), Праге (2009 г.) и Стокгольме (2011 г.). Кроме того, Общество «РусРиск» поддерживает постоянные контакты с Обществом риск-менеджмента и страхования США (RIMS), с Институтом риск-менеджмента Южной Африки (IRMSA) и с рядом других региональных ассоциаций. В апреле 2006 г. Общество присоединилось к деятельности Международной Федерации ассоциаций риск-менеджмента и страхования (IFRIMA), а Пре-

зидент «РусРиска» В.В. Верещагин вошел в состав Совета директоров этой федерации.

В настоящее время, как сказал выступавший, основными направлениями работы общества являются организация и проведение национальных и международных конференций, форумов и выставок по проблематике управления рисками. В частности, «РусРиск» является организатором ежегодного международного форума в Москве «Управление рисками: решения для России», а также соорганизатором ряда представительных конференций, проводимых ВНИИГАЗ, Минэнерго РФ, компаниями C5 (Лондон), MarcusEvans (Прага), Leading Ventures Associates (LVA), IC Energy и др. В течение многих лет Общество «РусРиск» проводит ежегодный российский конкурс «Лучший риск менеджмент года», а также рекомендует лучшие проекты на ежегодные конкурсы FERMA, «Strategic Risk», «Business Insurance Europe» и т.п.

Докладчик заострил внимание на том, что Общество «РусРиск» реализует обширную исследовательскую программу, в рамках которой проводится работа по созданию национальных стандартов в области управления рисками в различных отраслях экономики, осуществлен перевод международного стандарта по риск менеджменту ISO 31000: 2009 и подготовлен проект национального стандарта ГОСТ Р ИСО 31000-2010¹, адаптированы к российским условиям европейские стандарты риск-менеджмента FERMA для предприятий, разрабатывается совместно с РСПП проект профессионального стандарта по риск-менеджменту. По инициативе Общества «РусРиск» создан Координационный совет по рискам при Росстандарте. Также совместно с

¹ Приказом Росстандарта от 21 декабря 2010 г. № 883-ст утвержден и введен в действие с 1 сентября 2012 г. ГОСТ Р ИСО 31000-2010 «Менеджмент риска. Принципы и руководство». Стандарт может использовать любое государственное, частное или общественное предприятие, ассоциация, группа лиц или отдельное лицо; Стандарт не является специфическим для какой-либо промышленности или отрасли.

НИУ ВШЭ по заказу Аналитического центра при Правительстве РФ выполняется риск-экспертиза ряда государственных программ, включенных в Стратегию-2020 и т.п. Заметное место в деятельности Общества занимают маркетинговые исследования и консультационная деятельность (в частности, совместно с компанией «Марш Риск Консалтинг», журналом «Русский полис» и др.).

В.В. Верещагин отметил, что одним из приоритетных направлений деятельности Общества «РусРиск» является обучение, повышение квалификации и сертификация специалистов в области управления рисками в России. Для этого реализуются программы обучения за рубежом, в частности, в Институте риск-менеджмента (IRM, Великобритания), Euromoney Training (Великобритания), дистанционное обучение в Ирландском институте Research and Markets Ltd, а также обучение у нас в стране, в Финансовом университете при Правительстве РФ, в РАГС, в Государственной академии специалистов инвестиционной сферы (ГАСИС). Общество «РусРиск» всячески способствует созданию в России системы широкого доступа специалистов к информации в области управления рисками, при поддержке Общества издан фундаментальный учебник по управлению рисками, публикуются статьи в журналах «Проблемы анализа рисков», «Финансовые риски»; готовится серия публикаций «Рекомендации и комментарии к стандартам управления рисками»; для Интернет-сайта Общества² разрабатывается рубрика «База знаний», осуществляется информационное сотрудничество со многими периодическими изданиями и Интернет-ресурсами, такими как «Аналитический банковский журнал», «Генеральный директор», «БДМ», БиСер, Финанс, АК&М и т.п.

Доклад директора Фонда энергетического развития С.С. Пикина был посвящен актуальной теме «Политические и регуляторные риски на энергетическом рынке России».

² «Русское общество управления рисками» // www.rirms.ru.

Докладчик обрисовал современное состояние электроэнергетического сектора России. При установленной мощности электростанций России на 01.01.2011 г. в размере 214,8 ГВт и выработке электроэнергии за 2010 г. в объеме 1025 млрд кВт·ч в 2011 г. прогнозируется рост электропотребления на 1,7–2%.

Как отметил выступавший, текущие условия функционирования отрасли характеризуются высокой степенью износа электросетевого и энергетического оборудования, выбытием энергетического оборудования (прогноз к 2020 г. – около 12–15%), низкой эффективностью предприятий отрасли (высокий уровень операционных затрат, использование морально устаревших технологий, низкие технико-экономические показатели работы оборудования), ростом электропотребления и цен на топливо (цены на газ растут примерно на 15% ежегодно), задаваемыми Правительством Российской Федерации жесткими ограничениями роста цен на электроэнергию (на уровне не выше прогнозируемой инфляции), значительным объемом перекрестного субсидирования, ограничением темпа роста тарифов для населения и тарифов на тепловую энергию, а также отсутствием отечественных высокоэффективных разработок в области парогазовых установок и электросетевого оборудования.

С.С. Пикин подчеркнул, что в целом отрасль испытывает острую потребность в модернизации и развитии, возрастает риск снижения надежности энергоснабжения потребителей, особенно в части подключения новых потребителей, сдерживание темпов развития экономики Российской Федерации, недостаточные объемы доступных для инвестирования ресурсов энергетических компаний и т.п. Для исправления ситуации, по мнению директора Фонда, необходимо организовать на территории Российской Федерации энергомашиностроительные производства, способные выпускать современную продукцию, соответствующую мировым стандартам. В то же время сложившаяся в электроэнергетике система рынков, включающая кроме оптового

рынка, рынок электроэнергии, рынок мощности и рынок системных услуг, по мнению С.С. Пикина, должна обеспечить как надежность и экономическую эффективность энергоснабжения в краткосрочной и долгосрочной перспективе, так и преодоление возможных факторов риска.

В докладе вице-президента Общества «РусРиск» и члена Правления российского отделения PRMIA³, к.э.н. М.А. Рогова «Бенчмаркинг рисков» были охарактеризованы перспективы использования различных внешних индексов на этапах анализа и мониторинга рисков (в соответствии с международным стандартом риск-менеджмента ИСО 31000). На примере гидроэнергетической компании им были продемонстрированы возможности использования таких индикаторов рыночных и кредитных рисков, как индексы подразумеваемой волатильности отраслевых и географических сегментов фондового рынка, валютного рынка, индексы кредитного спреда и т.п. Особое внимание в докладе было уделено бенчмаркингу управления операционными рисками на основе уяснения динамики связи дефектов различных узлов оборудования и иных событий, обусловленных проявлениями операционного риска и объясняемых, как правило, человеческим фактором, и семейства индексов геомагнитной активности, так называемых RogovIndex(c). Используя аналог модели Джеймса Ризона «Швейцарский сыр» (описывает проникновение сбоев сквозь слабые места бизнес-процессов различного уровня, приводящих к реализации инцидентов), докладчик проиллюстрировал наличие связи между моментами обнаружения дефектов оборудования в лагированных временных рядах событий операционного риска и предваряющих их изменений индексов геомагнитной активности.

Докладчик порекомендовал уделять внимание развитию и применению бенчмаркинга рисков, а также обратил внимание ау-

³ PRMIA – Professional Risk Managers International Association // <http://www.prmia.org>.

дитории на перспективность использования при анализе экономического риска (особенно в малом бизнесе) краудсорсинга⁴. В качестве положительного примера, докладчик привел Интернет-платформу Ушахида, которая используется для построения географических карт на основе регистрации инцидентов по добровольным сообщениям несвязанных друг с другом очевидцев.

Доклад руководителя Департамента по внутреннему контролю и управлению рисками энергетической компании ДТЭК (Украина) И.А. Андроповой был посвящен проблеме управления экологическим риском на предприятиях компании. Для реализации функции управления экологическим риском, по мнению докладчика, важное значение имеет специфика компании, которая в данном случае состоит в том, что в ее состав входят предприятия различных технологических переделов энергетического цикла: угледобывающие, генерирующие и энергораспределяющие предприятия. Экологические факторы риска отнесены докладчиком к так называемым долгосрочным, поскольку они проявляются в течение длительных периодов времени и в стратегически важных областях деятельности. Основываясь на такой позиции, специалисты компании ДТЭК разработали фирменную методику управления экологическими рисками. И.А. Андропова сказала, что согласно данной методике оценка экологического риска осуществляется по двум направлениям: оценка последствий проявления некоторого фактора экологического риска (штрафы и ущерб, перерыв производства, репутационные и уголовные последствия) и оценка вероятности проявления фактора (оценка изменения вероятности подверженности риску за последний год, анализ истории реализации фактора

⁴ Краудсорсинг (англ. crowdsourcing, crowd – «толпа» и sourcing – «использование ресурсов») – передача определённых производственных функций неопределённому кругу лиц на основании публичной оферты, не подразумевающей заключение трудового договора (Википедия).

риска за последние 5 лет и т.п.). Методика предусматривает группирование факторов экологического риска по критерию существенности ущерба от реализации рассматриваемого фактора. Как сообщила выступавшая, в ходе внедрения данной методики на предприятиях компании были проанализированы возможные факторы экологического риска и сформированы реестры существенных для предприятий компании факторов экономического риска. Методика регламентирует работу системы управления экологическим риском, которая интегрирована в систему экологического менеджмента компании. В заключение докладчик отметила, что на финансирование мероприятий по снижению уровня экологического риска компания, как правило, направляет фиксированную долю затрат на реализацию годовой инвестиционной программы.

В докладе заведующего лабораторией Центрального экономико-математического института РАН, д.э.н. Р.М. Качалова «Системный риск-менеджмент и стратегическое управление современным предприятием» были представлены последние достижения операциональной теории экономического риска и основанные на этой теории методические рекомендации по управлению уровнем экономического риска в процессах стратегического планирования деятельности предприятий.

С докладом «Создание и внедрение корпоративной системы управления рисками (КСУР) в энергетическом холдинге – опыт ИНТЕР РАО ЕЭС» выступил директор по внутреннему контролю и рискам ОАО «ИНТЕР РАО ЕЭС» К.В. Завизенов. Автор начал свое сообщение с общей характеристики деятельности крупнейшего энергетического холдинга, имеющего активы в области генерации, инжиниринга, распределения и трейдинга⁵ в России и за рубежом. Докладчик подчеркнул, что КСУР ориентирована на решение задач

⁵ В докладе термин «трейдинг» употреблен в смысле операций продажи и последующей покупки тех же ценных бумаг в расчете на получение прибыли за счет изменения их курсовой стоимости.

стратегического управления холдингом и призывает все стратегические процессы предприятий холдинга, при этом функции управления риском распределены между уровнями дивизиональной организационной структуры холдинга таким образом, что концептуальные, общеметодологические и стратегические функции формирования КСУР закреплены за головной компанией, а конкретные функции управления риском – за структурными подразделениями холдинга (дивизионами и филиалами).

Докладчик подчеркнул, что ключевыми документами, регламентирующими деятельность КСУР в холдинге, являются планы мероприятий по снижению риска и карты рисков. Эти документы формируются на уровне холдинга, детализируются по дивизионам и предприятиям и ежегодно рассматриваются и утверждаются Советом директоров. Докладчик охарактеризовал виды рисков, с которыми работает КСУР, и технологию актуализации релевантных факторов риска, распределения ответственности и формирования мероприятий по снижению уровня риска в приоритетных направлениях деятельности холдинга.

В докладе начальника отдела мониторинга систем управления рисками Департамента внутреннего аудита ОАО «Газпромнефть» У.С. Кремлевой «Актуальные подходы к внедрению базовых процессов ИСУР в ОАО «ГАЗПРОМ НЕФТЬ» основное внимание было уделено организации мониторинга риска в ходе создания интегрированной системы управления риском (ИСУР). У.С. Кремлева констатировала, что работы по созданию ИСУР, начатые в компании в 2008 г., в настоящее время доведены до «базового» уровня зрелости, выявлена карта рисков компании и ее структурных подразделений, сформирован консолидированный свод знаний о рисках компании, разработан стандарт предприятия «Порядок проведения мониторинга ИСУР в структурных подразделениях компании» и др.

Были также заслушаны доклады директора по России холдинга «Ancoг» С. Гадецкого «Оптимизация бизнес-процессов за счет

улучшения практик управления персоналом», руководителя Службы управления рисками и внутреннего контроля компании «КазМунайГаз» (Казахстан) Г. Байгожиной «Актуальные проблемы создания ИСУР», руководителя Департамента анализа, финансового моделирования и страхования ОАО «ИНТЕР РАО ЕЭС» А. Кокоша «Стратегия управления финансовыми рисками в холдинге с зарубежными активами», начальника Управления по рискам ООО «Газпром экспорт» Д. Шухардиной (Россия) «Корпоративная система управления рисками группы в разрезе рыночных и кредитных рисков», руководителя Дирекции по управлению рисками компании «РусГидро» К. Бабаева «Усиление роли подразделений риск-менеджмента в текущих рыночных условиях», риск-менеджера компании «StatOil» Р. Нилсена (Норвегия) «Комплексный подход к созданию интегрированных систем управления риском» и др.

Одно из заседаний конференции, прошедшее в формате Круглого стола, было посвящено проблеме учета репутационного риска. В ходе обсуждения выступили К. Бабаев (РусГидро), К.В. Завизенов и А. Кокош (ИНТЕР РАО ЕЭС), С. Казанцева (MarcusEvans).

НАУЧНЫЙ СЕМИНАР «МЕТОДОЛОГИЯ МОДЕЛИРОВАНИЯ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ»

М.А. Рыбачук

29 февраля 2012 г. в Международном университете природы, общества и человека «Дубна» состоялось первое заседание нового научного семинара «Методология моделирования социально-экономических процессов». Организаторами мероприятия выступили Центральный экономико-математический институт РАН, Экономический факультет МГУ им. М.В. Ломоносова (Кафедра «Математических методов анализа экономики») и факультет Экономики и управления университета «Дубна». Помимо организаторов в работе первого семинара приняли участие представители таких организаций, как Институт проблем управления РАН, Институт системного анализа РАН, Институт экономики РАН, Финансовый университет при Правительстве РФ, Центр проблемного анализа и государственно-управленческого проектирования, Агентство по прогнозированию балансов в электроэнергетике и др.

Открывая заседание, ректор университета «Дубна» профессор Д.В. Фурсаев отметил актуальность проблематики семинара, пожелал успеха новому научному начинанию и выразил надежду, что семинар постепенно привлечет широкий круг представителей разных научных школ и направлений, работающих в области моделирования сложных процессов в экономике и обществе, и станет представительным научным форумом обще-

© Рыбачук М.А., 2012 г.