

## **РАЗРАБОТКА ИНТЕГРИРОВАННОЙ СИСТЕМЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА КАК ИНСТРУМЕНТА ПОВЫШЕНИЯ ЭФФЕКТИВНОСТИ РАБОТЫ КОМПАНИЙ ЭЛЕКТРОЭНЕРГЕТИКИ РФ**

**Эльрих Ю.В.**

**Научный руководитель – д.т.н., профессор Петровский Э.А.**

*Сибирский федеральный университет*

Электроэнергетика России является одной из тех отраслей, которая долгие годы функционировала в условиях монополии, управление рисками осуществлялось только в рамках управления издержками и реализации инвестиционных программ, вследствие того, что рынка как такового не было, хеджирование ценовых рисков, а также повышение эффективности производства в целях выживания в условиях конкуренции было нецелесообразным. И, как результат, собственники и руководители энергокомпаний стали задумываться об управлении рисками только недавно – бизнес стал более управляемым и конкурентным. В настоящий момент не существует конкретной технологии управления рисками в электроэнергетике, еще далеко не каждая компания отрасли хотя бы задумывается над этим вопросом. В большинстве случаев система риск-менеджмента представляет собой либо структуру выявленных рисков, в отношении которых осуществляется мониторинг их динамики без разработки интегрированного подхода, либо ориентацию на конкретные риски, например, ценовые – разрабатываются или приобретаются программы по прогнозированию рыночных цен, производственные – приобретаются специализированные программы по ремонту оборудования. Каждая из этих компаний самостоятельно определяет теоретическую базу по управлению рисками, вследствие того, что не существует конкретных требований законодательства и не был разработан единый подход к управлению рисками в электроэнергетике. Основу этой базы составляют принципы риск-менеджмента, которые могут быть применимы для компании практически любой отрасли, ведь сущность риска и цели его управления, независимо от вида и метода управления, остаются одними и теми же.

Учитывая, что электроэнергетическая отрасль находится в настоящий момент на заключительном этапе реформирования, не разработана часть важных нормативно-правовых актов, определяющих дальнейшее развитие отрасли, обобщенных исследований, посвященных построению интегрированной системе риск-менеджмента, еще нет. Но актуальность проблемы становится все более очевидной с каждым днем. В основном, разработкой системы управления рисками на предприятиях электроэнергетики занимаются сами специалисты и руководители электроэнергетических компаний, которые являются самыми первыми очевидцами изменений, происходящих в отрасли, и их влияния на финансово-хозяйственную и производственную деятельность компании. Ученому, даже имеющему очень высокий уровень знаний в отдельности в электроэнергетике или риск-менеджменте, довольно сложно теоретически выстроить систему управления рисками для энергокомпании, функционирующей в условиях неопределенности и постоянной волатильности оптового рынка электроэнергии (мощности).

Но, тем не менее, при построении интегрированной системы риск-менеджмента целесообразно руководствоваться работами ученых, посвященными базовым подходам и теоретическим основам риск-менеджмента. Также стоит отметить, что в последнее

время руководители крупных электроэнергетических компаний и консалтинговых агентств заинтересовались вопросом риск-менеджмента в электроэнергетике, в этой связи проводятся различные конференции, круглые столы, ориентированные на обмен опытом и формирование единой стратегии по управлению рисками. Значительную часть теоретической базы управления рисками в электроэнергетике составляют законодательные акты, которые регулируют как работу оптового и розничного рынка, ценовые параметры реализации электроэнергии (мощности) и оказания системных услуг, так и уровень поддержания энерго мощностей частными и государственными компаниями.

В целях внедрения эффективной системы управления рисками, представляющей собой систематический процесс выявления, оценки и регулирования рисков во всех сферах деятельности, направленный на повышение надежности, достижения запланированных результатов, содействие устойчивому развитию и росту эффективности распределения ресурсов, целесообразна реализация следующих мероприятий:

- анализ общих теоретических подходов к управлению рисками на предмет применимости этих подходов к конкретной отрасли;
- анализ современного развития отрасли, ее нормативно-законодательной базы;
- разработка и внедрение бизнес-процесса по управлению рисками;
- разработка методологии по управлению рисками;
- разработка положения о рабочей группе по рискам;
- проведение внутреннего обучения по управлению рисками;
- создание корпоративной информационной системы по управлению рисками;
- проведение бенчмаркинга российских и зарубежных компаний;
- введение ключевых показателей эффективности по рискам (KRI – key risk indicators).

Бизнес-процесс по управлению рисками, что очень важно, должен быть интегрирован во все остальные бизнес-процессы компании. В подразделениях коренным образом должно поменяться отношение к риск-менеджменту, руководители и сотрудники в идеале должны воспринимать систему управления рисками не как «обязаловку» составления непонятных и ненужных отчетов, отвлекающих их от основной деятельности. Интегрированная система управления рисками будет работать таким образом, что при осуществлении должностных обязанностей подразделения будут понимать важность и эффективность своевременного выявления, адекватной оценки и своевременной реализации мероприятий по реагированию на риски.

Бенчмаркинг, предлагаемый в качестве заимствования передовых практик по построению и ведению системы управления рисками, является давно используемым инструментом управления эффективностью предприятия. Необходимость практического применения бенчмаркинга в риск-менеджменте представляет собой способ выявления новых, передовых направлений у зарубежных электроэнергетических компаний, учитывая нехватку положительного опыта в российских компаниях.

Практическую значимость имеет и корпоративная информационная система, являющаяся вспомогательным инструментом построения доступной для персонала, не требующей больших трудозатрат для формирования отчетности, и неотъемлемой частью эффективной системы риск-менеджмента.

В результате интегрированная система управления рисками позволит выявить и по возможности устранить наиболее болевые точки электроэнергетических предприятий, существенно повысить эффективность деятельности всей компании, приведет к повышению финансовых результатов и надежности работы, что,

безусловно, окажет положительное влияние на надежность энергообеспечения, экономику и развитие страны в целом.