

## Семинар «Риск – менеджмент в электроэнергетике»



### Краткое описание курса

«Риск-менеджмент в электроэнергетике» - это семинар, который ознакомит слушателей с современными технологиями управления рисками, нормативно-правовой базой, методами и инструментариями риск - менеджмента с учетом особенностей энергетики России. Стоимость участия одного слушателя: 18 700 рублей (в том числе НДС)

### Цели семинара

Предложение целевой аудиторией методик и решений в области:

- независимого мониторинга состояния энергообъектов и энергосистем
- исследования рисков и угроз, «узких мест» в сфере надежности, безопасности и энергоэффективности, построения системы управления рисками энергокомпаний
- технико-экономического обоснования мероприятий по повышению надежности, безопасности и энергоэффективности, бизнес-планирования и организации финансирования
- внедрения комплексных систем управления рисками компании (единовременно или по блокам):
  - мониторинговые решения (с применением «черных ящиков»)
  - систем анализа и поддержки принятия решений (Expert Choice и др.)
- аудита и анализа имеющихся в компании систем и методов управления рисками, повышения надежности, безопасности и энергоэффективности.

### Целевая аудитория

Специалисты, принимающие решения при построении системы управления рисками энергокомпаний: главные инженеры, заместители руководителя по экономике, информационным технологиям, специалисты по управлению рисками и другие заинтересованные лица.

### Дата семинара

26 октября 2011 года

### Докладчики

Рогов М.А., Бабаев К.В.



РОСАТОМ



Корпоративная  
Академия  
ГК "РОСАТОМ"

Программа семинара

Тема № 1

Содержание

**Современные концепции построения риск-менеджмента на предприятии энергетической отрасли**

Цели и задачи риск менеджмента. История развития риск менеджмента. Современное состояние теории управления рисками.  
Подходы к внедрению риск-менеджмента на предприятии. Основные трудности и пути их преодоления. Мотивация персонала на качественное управление рисками. Организация процесса и процедуры риск-менеджмента. Формирование нормативной базы риск-менеджмента. Виды рисков и их классификации. Склонность к риску и риск-аппетит. Портфельный подход. Менеджмент, ориентированный на стоимость.

Тема № 2

Содержание

**Управление стратегическими и инвестиционными рисками предприятия**

Стратегические и репутационные риски. SWOT-анализ и др. Стратегические риски потери бизнеса. Обзор актуальных сценариев стратегических рисков в России и мире на основе лучшей практики.  
Стратегические цели организации; анализ, идентификация рисков; качественная и количественная оценка рисков; контроль, принятие решения по управлению рисками и реагирование на риск; мониторинг выполнения мероприятий по реагированию на риск. Раскрытие информации о рисках.  
Система рисков реализации инвестиционного проекта на различных этапах разработки и реализации проекта. Имитационное моделирование проектных рисков. Анализ чувствительности KPI проектов. Диверсификация портфеля проектов и риски потери управляемости. Преимущества встроенных реальных опционов отказа, замены и др.  
Практические занятия. Выработка сценариев стратегического риска проектов и мер реагирования

Тема № 3

Содержание

**Современные концепции интегрированного управления рисками**

Международные и национальные профессиональные организации в области риск-менеджмента (GARP, PRMIA, FERMA, РусРиск и др.), квалификации FRM, PRM и др. Отличие функций риск-менеджмента от аудита, контроллинга, безопасности и других смежных бизнес-процессов. Стандарты риск-менеджмента: COSO, SoX, FERMA, ISO 31000, BASEL-2, BCP, Solvency-2, GRI (отчетность по устойчивому развитию).

Тема № 4

Содержание

Показатели чувствительности и изменчивости. Доходность и волатильность, историческая, экспоненциально взвешенная, подразумеваемая, волатильность портфеля, задача Г. Марковица. Концепция Value-at-Risk (VaR). Методы расчета VaR: ковариационный (дельта-нормальный), метод исторического моделирования, метод Монте-Карло. Условный VaR (CVaR). Верификация моделей

Риск-менеджмент в  
электроэнергетике

## Современные инструменты оценки рисков

расчета VaR Стресс-тестирование. Рентабельность с учетом риска (RARORAC). Систематический и индивидуальный риск. Деривативы. "Греческие" показатели. Способы управления рыночными рисками: диверсификация портфеля м хеджирование, дюрация и иммунизация портфеля. Основные подходы к управлению рисками невыполнения обязательств контрагентами. Понятие скоринга, кредитного рейтинга, частоты дефолта, кредитного спреда, уровня восстановления. Обзор моделей оценки кредитного риска Z-score, CreditMetrics, Credit +, KMV.

Практические занятия. Выявление и оценка рисков, разработка методов реагирования и средств контроля.

Тема № 5

Содержание

## Управление операционными \производственными рисками

Операционные риски. Идентификация рисков: реестр и карта рисков. Карта стратегических рисков Мягкие и жёсткие факторы рисков и взаимосвязь с другими рисками. Инструментарий оценки операционных рисков: самооценка, рейтинговые оценки, история и анализ статистики убытков, ключевые показатели риска (KRI), операционный Value-at-Risk, реальные опционы. Риски персонала. Применение закона Бенфорда для выявления рисков внутреннего и внешнего мошенничества. Диверсификация и оптимизация бизнес-процессов, самострахование, критерии качества и надежности страховой защиты. Сценарии стресса и план действий в непредвиденных (чрезвычайных) ситуациях для управления непрерывностью бизнеса.

Практические занятия. Выбор ключевых показателей риска для различных бизнес-процессов. Сравнительный анализ эффективности страховых программ.

Тема № 6

Содержание

## Управление рыночными и кредитными рисками

Способы управления рыночными рисками: диверсификация портфеля м хеджирование, дюрация и иммунизация портфеля. Основные подходы к управлению кредитными рисками. Понятие скоринга, кредитного рейтинга, частоты дефолта, кредитного спреда, уровня восстановления. Обзор моделей оценки кредитного риска Z-score, CreditMetrics, Credit +, KMV. Корпоративные стандарты кредитной политики на основе внутренних кредитных рейтингов контрагентов. Способы управления рисками качества поставщиков (сертификация поставщиков, страхование поставок, аутсорсинг качества поставок).