

ЗОЛОТАРЬОВ Д.О., студент, НТУ «ХП»

ПРОСКУРНЯ О.М., канд.техн.наук, доцент, НТУ «ХП»

ДОСЛІДЖЕННЯ ТА АНАЛІЗ ВПРОВАДЖЕННЯ КОНЦЕПТУАЛЬНИХ ПОЛОЖЕНЬ РИЗИК-ОРІЄНТОВАНОГО МЕНЕДЖМЕНТУ В ЕЛЕКТРОЕНЕРГЕТИЧНИХ КОМПАНІЯХ

Наукова робота присвячена проблемам впровадження системи ризик-менеджменту в практику корпоративного управління компаній енергетичного сектора. В умовах переходу на ринкові відносини і лібералізації електроенергетичного ринку (ЕР) в процес аналізу і прийняття рішень щодо її розвитку виявляються втягнутими багато учасників (суб'єктів відносин) з різними інтересами. Наявність значної кількості груп суб'єктів відносин, кожен з яких приймає на себе частину ризику, в певній мірі є фактором ризику, оскільки невиконання хоча б одним з них своїх зобов'язань може привести до виникнення небажаних подій (наприклад, збитків (або втрат) в результаті порушення надійного режиму електропостачання). Тому при розробці стратегії і тактики поведінки на ЕР суб'єктам ринкових відносин необхідний систематичний аналіз ризиків, який передбачає включення управління ризиками в процес прийняття рішень на всіх тимчасових і ієрархічних рівнях.

Актуальність теми полягає в тому, що застосування концепції ризик-орієнтованого мислення допомагає енергетичному підприємству розуміти усі умови (в тому числі специфічні для електроенергетичній галузі), в яких воно функціонує; визначати ризики в якості основи для планування своєї діяльності; визначати обсяг документованої інформації.

Метою даної роботи є дослідження і аналіз теоретичних та практичних аспектів впровадження концептуальних положень ризик-орієнтованого менеджменту в електроенергетичні компанії.

Складність адаптувати вербальні та якісні методи оцінки ризиків до

специфічних особливостей виробництва і передачі ЕЕ визначається тим, що елементи системи енергопостачання, починаючи з генеруючою установкою і закінчуючи приймачами у споживача, пов'язані між собою єдиним технологічним процесом (енергопотоків), тобто представляють собою безперервний ланцюг перетворення ЕЕ, миттєво розповсюджується, і тому виробництво її практично збігається зі споживанням. На всіх фазах перетворення, включаючи стадію споживання ЕЕ, можливості її запасу відсутні. Все це підсилює ризикову компоненту даного бізнесу і вимагає вивчення складного процесу з системних позицій.

Розроблено алгоритм оцінки стану систем ризик-менеджменту, що включає аналіз: організаційної структури управління ризиками енергокомпанії; нормативно-методологічної бази управління ризиками енергокомпанії; інформаційно-аналітичного забезпечення управління ризиками енергокомпанії. Оцінка формування стану системи ризик-орієнтованого менеджменту проведена на прикладі ОГК (оптова генеруюча компанія - ОГК).

Було проаналізовано такі показники, як: середня питома вартість за період кризових ситуацій; глибина падіння питомої вартості енергокомпанії; ступінь відновлення питомої вартості енергокомпанії; стійкість відновлення питомої вартості енергокомпанії. Компанії з більш повно сформованою системою управління ризиками успішніше пройшли кризові ситуації і зуміли найповніше відновитися. Повнота формування системи управління ризиками в енергокомпанії позитивно пов'язана з найважливішими і критичними показниками ефективності її діяльності

Було проведено аналіз впровадження концептуальних положень ризик-орієнтованого менеджменту на чутливість енергокомпанії до ринкових ризиків; визначено що в електроенергетичній галузі не завжди можливо заздалегідь дати точну кількісну оцінку ризиків. На основі порівняльного та ретроспективного аналізу показана реальна ефективність системи при проходженні ризикової ситуації.