

Секция «43.9 Управление рисками и страхование: новые вызовы и возможности»

Управление взаимосвязанными группами рисков в нефтегазовой компании: концепция платформы для поддержки управленческих решений

Заявка № 1662973

Современные системы корпоративного управления рисками в нефтегазовых компаниях, как правило, ориентированы на ведение реестра отдельных рисков и плохо отражают их взаимное влияние и каскадные эффекты между подразделениями. В результате руководителям сложно оценить, как совокупность рисков отдельных департаментов трансформируется в интегральное воздействие на ключевые показатели компании и конкретные управленческие роли. Отмечается, что даже при наличии развитых ERM-процессов связь между группами рисков часто остаётся неформализованной и фиксируется лишь в экспертных комментариях, а не в структурированных моделях. На основе этого анализа обосновывается необходимость перехода от списочного формата к представлению риск-профиля компании в виде сети, где каждый риск связан с конкретными процессами, объектами, ролями и другими рисками.

В данной работе проанализированы следующие аспекты:

1. состояние и ограничения существующих ERM-подходов в нефтегазовой отрасли;
2. зарубежные публикации по сетевому моделированию рисков и их каскадных эффектов;
3. практики описания рисков на уровне департаментов

Предлагается концепция платформы поддержки управленческих решений, ориентированной на управление взаимосвязанными группами рисков в нефтегазовой компании. Ключевая идея платформы состоит в том, чтобы собирать данные о рисках из разных департаментов, приводить их к единой структуре и строить граф взаимовлияний на уровне процессов, подразделений и управленческих ролей. Такой подход позволяет моделировать сценарии каскадного развития событий и оценивать эффект совокупных рисков на стратегические цели. Дополнительно рассматривается возможность использования методов искусственного интеллекта для выявления скрытых корреляций между рисками и их влиянием на поведение руководителей при принятии решений.

Итогом данной работы является:

1. предложена концептуальная архитектура платформы поддержки решений с представлением риска в виде узла сети, связанного с процессами, ролями и другими рисками;
2. описаны базовые сценарии использования платформы руководителями и риск-менеджерами (оценка каскадных эффектов, приоритизация групп рисков, выбор управленческих действий).

Источники и литература

- 1) Ayele Y. Z., Barabady J., Droguett E. L. «Dynamic Bayesian Network-Based Risk Assessment for Arctic Offshore Drilling Waste Handling Practices» - Journal of Offshore Mechanics and Arctic Engineering, 2016, No. 6.
- 2) Kaplan R. S., Mikes A. «Managing Risks: A New Framework» - Harvard Business Review, 2012.

3) Muralidhar K. «Enterprise Risk Management in the Middle East Oil Industry» - International Journal of Energy Sector Management, 2010, №1

Иллюстрации

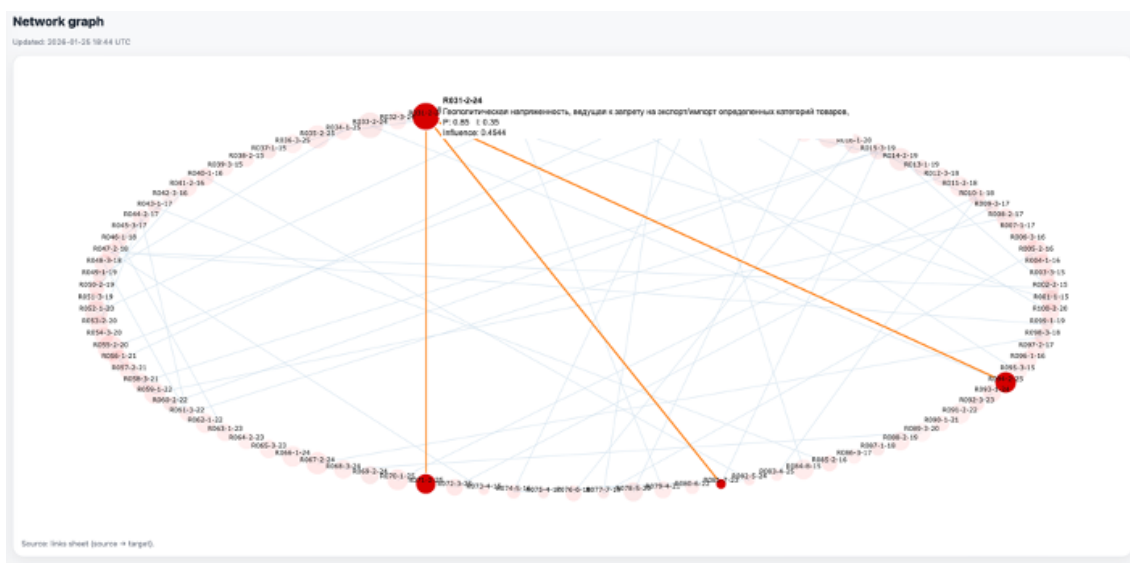


Рис. : Сетевой граф идентифицированных рисков на предприятии