

Практические инструменты анализа рисков энергетических предприятий

Тымуль Е. И.

Белорусский национальный технический университет

Одним из основных этапов анализа рисков, от качественного проведения которого во многом зависит эффективность управления рисками в целом, является оценка рисков. В практике риск-менеджмента существует большое количество инструментов для проведения анализа рисков, основными из которых являются следующие:

1. Метод экспертных оценок: комплекс логических и математико-статистических методов и процедур по переработке необходимой информации, связанных с деятельностью эксперта;

2. SWOT-анализ: таблица, позволяющая наглядно противопоставлять сильные и слабые стороны проекта, его возможности и угрозы;

3. Роза (звезда), спираль рисков: иллюстративная экспертная оценка рискованности факторов;

4. Метод аналогий или консервативные прогнозы: исследование накопленного опыта по проектам-аналогам с целью расчета вероятностей возникновения потерь;

5. Метод ставки процента с поправкой на риск: увеличение безрисковой ставки процента на величину надбавки за риск (рисковая премия);

6. Метод критических значений: нахождение тех значений переменных (факторов), проверяемых на риск, которые приводят расчетную величину соответствующего критерия эффективности проекта к критическому пределу;

7. Метод критических значений: нахождение тех значений переменных (факторов), проверяемых на риск, которые приводят расчетную величину соответствующего критерия эффективности проекта к критическому пределу;

8. «Деревья» решений: метод принятия статистических решений при выборе одного из альтернативных вариантов и формировании оптимальной стратегии.

Каждый из перечисленных инструментов имеет как свои достоинства, так и недостатки. Поэтому выбор того или иного инструмента анализа рисков должен проходить с учетом специфики как самого предприятия так и возникающих рисков. Для наиболее наглядной оценки влияния каждого вида риска энергетическим предприятиям будет целесообразно применять «спираль» рисков.