

Риск-менеджмент

Анализ рисков компании НОВАТЭК

РМВА-13
Колчанов И.С.
Кузнецова В.А.
Санин С.С.
Соловьев Р.С.

Цель работы

Цель:

Повысить эффективность деятельности компании за счет управления рисками

Задачи:

- Идентифицировать основные факторы риска
- Оценить факторы риска по причинам возникновения, степени и характеру влияния
- Разработать мероприятия по уменьшению степени опасности рисков, оценить стоимость внедрения
- Провести оценку эффективности имплементации системы управления рисками
- Использовать полученные данные в дальнейшей работе компании, которая позволит снизить риски компании до приемлемого уровня

О компании

ПАО «НОВАТЭК» является одним из крупнейших независимых производителей природного газа в России. Компания занимается разведкой, добычей, переработкой и реализацией природного газа и жидких углеводородов и имеет двадцатилетний опыт работы в российской нефтегазовой отрасли.

Сфера деятельности компании: производство природного газа.

Форма собственности: публичное акционерное общество.

География: месторождения и лицензионные участки расположены в Ямало-Ненецком Автономном Округе (ЯНАО).

Год основания: 1994

Оборот: 537,47 млрд руб. (2016 год, МСФО)

Число сотрудников: 4200 человек



НОВАТЭК

SWOT-анализ

| Сильные стороны | Слабые стороны |
|---|--|
| <ol style="list-style-type: none">1. Обширная материально-сырьевая база, гарантирующая устойчивый рост добычи.2. Новатэк входит в топ-5 мировых компаний по доказанным запасам природного газа.3. Соглашение о стратегическом партнерстве с РЖД4. Поставка природного газа на международный рынок в форме СПГ играет ведущую роль в долгосрочной стратегии Новатэка, позволяя диверсифицировать рынки.5. Штат квалифицированных сотрудников более 4000 чел. | <ol style="list-style-type: none">1. Зависимость от пропускной способности магистральных трубопроводов2. Зависимость компании от ПАО «Транснефть» и ОАО «РЖД» для транспортировки газа.3. Финансовые риски связанные с изменением курса рубля. |

SWOT-анализ

| Возможности | Угрозы |
|---|--|
| <ol style="list-style-type: none">1. Оптимизация и расширение существующих и создание новых маркетинговых каналов.2. Устойчивый рост объемов производства связанный с собственными разработками и материально-сырьевой базой.3. Увеличение мощности переработки для максимизации рентабельности | <ol style="list-style-type: none">1. Правительственное регулирование цен на внутреннем рынке.2. Усилившаяся конкуренция в российской газовой отрасли.3. Потенциальные увеличения тарифов на транспортировку газа.4. Влияние рыночных цен на финансовые результаты компании. |

Перечень факторов риска ПАО «НОВАТЭК»

| № | Название | Характеристики | Причины | Последствия |
|---|-------------------|---|---|---|
| 1 | Конкурентный | Разработка современных технологий и методик | Отсутствует направление научно-методического обеспечения и инноваций | Снижение конкурентоспособности, финансовые потери (от несовершенных сделок) |
| 2 | Кадровый | Потеря квалифицированного персонала, влияние демографических ям и снижение популяризации научно-технических направлений | Недостаточная система мотивации, ненормированный график работы, не оптимального распределения рабочей нагрузки | Невыполнение в установленный срок работ, выплата неустоек и штрафов |
| 3 | Кредитный | Изменение контрактных условий и возможностей компании | увеличение зависимости компании от кредитов на покупку техники и программного обеспечения, неоптимальная кредитная политика компании | Штрафы и иски о банкротстве |
| 4 | Риск потребителей | Снижение потребительского спроса на товар потребителей | Увеличение доли альтернативных видов энергии | Финансовые потери от незаключения договоров |
| 5 | Квалификационный | Отсутствие специализированных образовательных программ и снижение качества преподавания | Высокая стоимость качественных образовательных услуг в связи с высокой стоимостью оборудования и недоступными патентными разработками | Дополнительные затраты на обучение сотрудников для выполнения стандартных задач |

Перечень факторов риска ПАО «НОВАТЭК»

| № | Название | Характеристики | Причины | Последствия |
|----|---------------------|---|---|---|
| 6 | Валютный | Изменение курса валюты при международных валютных операциях | Не прогнозируемое изменение цен на стоимость проектных работ и иностранного программного обеспечения | В случае укрепления рубля (понижение стоимости доллара США) снижается рублевая выручка |
| 7 | Безопасность | Утечка инсайдерской информации, нарушение системы производственного цикла | Отказ ключевого программного обеспечения, в том числе за счет кибер-атак и нарушения корпоративной безопасности сотрудниками компании | Потеря важной информации, невыполнение в установленный срок работ, выплата неустоек и штрафов |
| 8 | Потребительский | Снижение потребительского спроса на услуги | Переход на самообеспечение компаний заказчиков | Финансовые потери от незаключения договоров |
| 9 | Управленческий | Отсутствие квалифицированных управленческих кадров | Отсутствие управленческого образования руководителей и субъективные кадровые решения | Принятие руководством ошибочных субъективных решений |
| 10 | Человеческий фактор | Ошибки в принятии решений и выполнении трудовых обязательств | Технические ошибки за счет ухудшения состояния здоровья и не оптимального распределения рабочей нагрузки | Снижение качества работ и срыв сроков, выплата неустоек и штрафов, финансовые потери при принятии ошибочных решений |

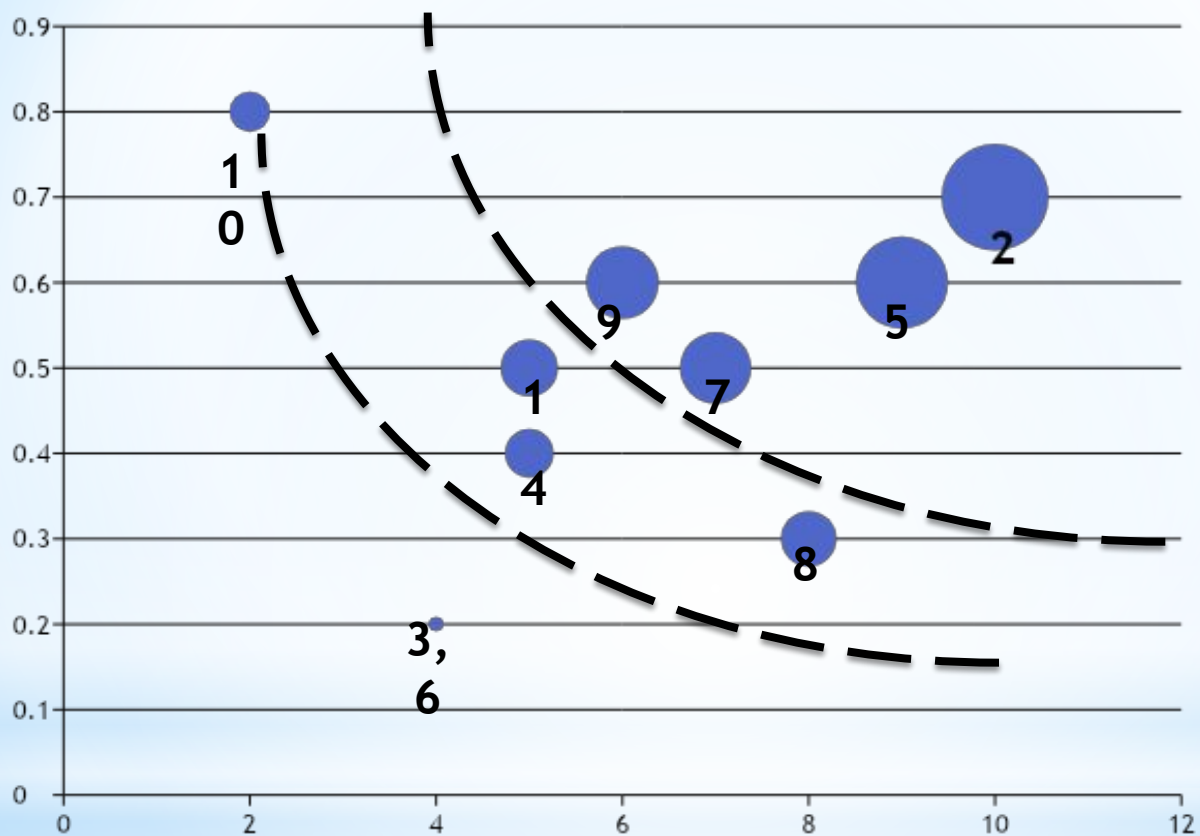
Оценка рисков ПАО «НОВАТЭК»

| № | Название | Оценка потерь (1-10) | Вероятность возникновения (0-1) | Степень опасности риска |
|----|------------------------|-------------------------|------------------------------------|----------------------------|
| 1 | Конкурентный | 5 | 0,5 | 2,5 |
| 2 | Кадровый | 10 | 0,7 | 7 |
| 3 | Кредитный | 4 | 0,2 | 0,8 |
| 4 | Риск потребителей | 5 | 0,4 | 2 |
| 5 | Квалификационн ый | 9 | 0,6 | 5,4 |
| 6 | Валютный | 4 | 0,2 | 0,8 |
| 7 | Безопасность | 7 | 0,5 | 3,5 |
| 8 | Потребительский | 8 | 0,3 | 2,4 |
| 9 | Управленческий | 6 | 0,6 | 3,6 |
| 10 | Человеческий фактор | 2 | 0,8 | 1,6 |

Ранжирование рисков ПАО «НОВАТЭК»

| № | Название | Оценка потерь (1-10) | Вероятность возникновения (0-1) | Степень опасности риска | Ранг риска |
|----|------------------------|-------------------------|---------------------------------------|----------------------------|---------------|
| 2 | Кадровый | 10 | 0,7 | 7 | 1 |
| 5 | Квалификационный | 9 | 0,6 | 5,4 | 2 |
| 9 | Управленческий | 6 | 0,6 | 3,6 | 3 |
| 7 | Безопасность | 7 | 0,5 | 3,5 | 4 |
| 1 | Конкурентный | 5 | 0,5 | 2,5 | 5 |
| 8 | Потребительский | 8 | 0,3 | 2,4 | 6 |
| 4 | Риск потребителей | 5 | 0,4 | 2 | 7 |
| 10 | Человеческий фактор | 2 | 0,8 | 1,6 | 8 |
| 3 | Кредитный | 4 | 0,2 | 0,8 | 9 |
| 6 | Валютный | 4 | 0,2 | 0,8 | 10 |

Карта рисков ПАО «НОВАТЭК»



Мероприятия по уменьшению влияния рисков

| № | Название | Ранг | Мероприятия |
|----|---------------------|------|--|
| 2 | Кадровый | 1 | Внедрение эффективной системы мотивации, популяризация научно-технического направления в школах и вузах |
| 5 | Квалификационный | 2 | Обучение персонала, система обучения и удержания |
| 9 | Управленческий | 3 | Обучение руководителей высшего звена |
| 7 | Безопасность | 4 | Внедрение технологичных систем безопасности |
| 1 | Конкурентный | 5 | Развитие собственных новых технологий и методик |
| 8 | Потребительский | 6 | Развитие собственных новых технологий и методик |
| 4 | Риск потребителей | 7 | Развитие направлений связанных с альтернативными источниками энергии |
| 10 | Человеческий фактор | 8 | Планирование работ, сокращение нештатных ситуаций за счет контроля и профилактики |
| 3 | Кредитный | 9 | Снижение кредитной зависимости за счет проведения мероприятий по снижению финансовых рисков и и перераспределения финансовых потоков |
| 6 | Валютный | 10 | Влиять на валютный риск компания не имеет возможности. Снизить риск поможет заключение форвардных и фьючерсных контрактов |

Мероприятия по устранению наиболее опасного риска

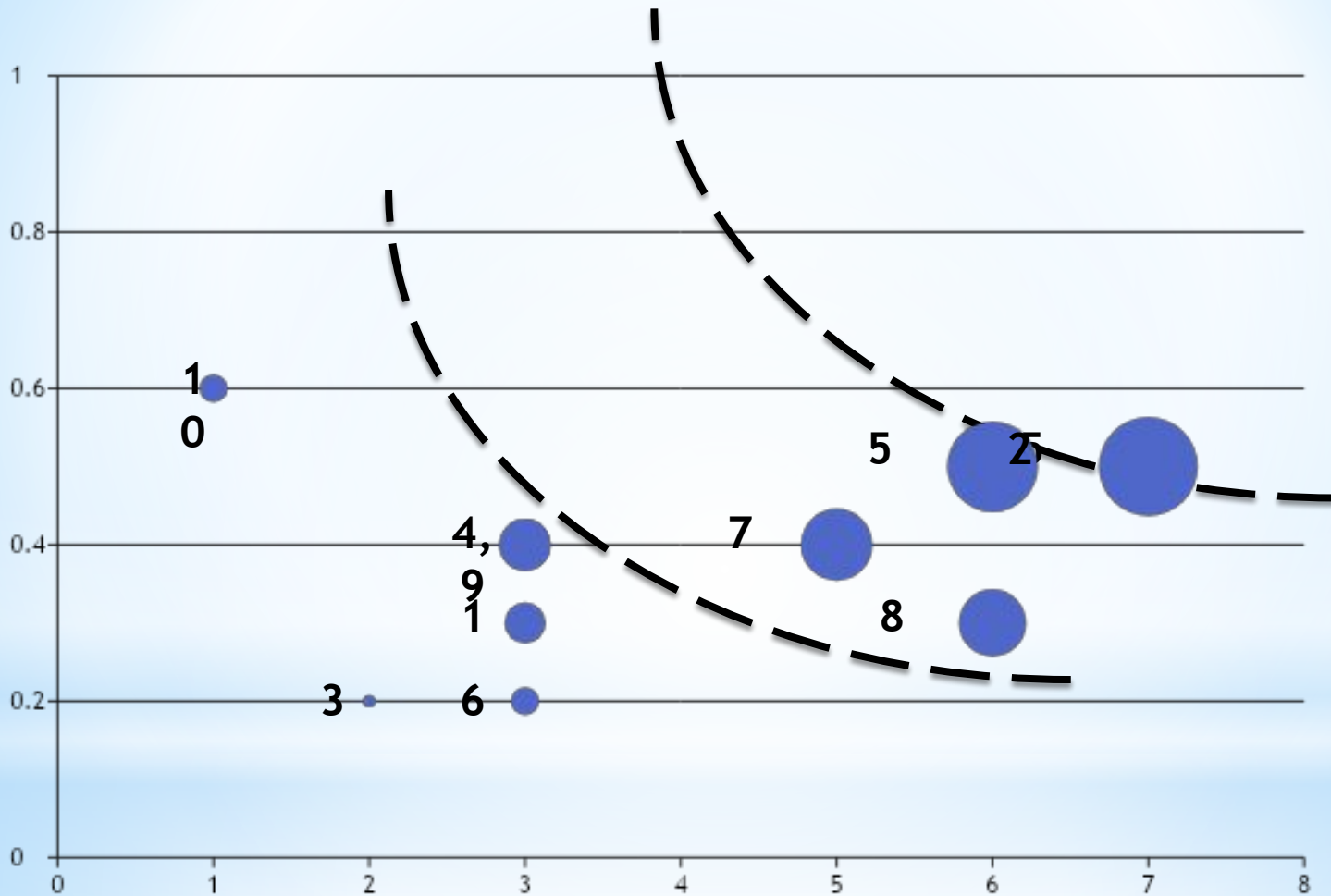
Кадровый риск

- * Разработка программ по привлечению молодых специалистов по профильным специальностям и улучшению условий труда;
- * Разработка программы по повышению качества подготовки и переподготовки специалистов, в том числе в соответствии с профессиональными стандартами;
- * Разработка программы целевого набора в образовательные учреждения;
- * Разработка программ на удержание специалистов

Оценка рисков после проведения мероприятий

| № | Название | До мероприятий | | | | После мероприятий | | | |
|----|---------------------|----------------|------|------|------|-------------------|------|------|------|
| | | О.П. | В.В. | С.О. | Ранг | О.П. | В.В. | С.О. | Ранг |
| 2 | Кадровый | 10 | 0,7 | 7 | 1 | 7 | 0,5 | 3,5 | 1 |
| 5 | Квалификационный | 9 | 0,6 | 5,4 | 2 | 6 | 0,5 | 3 | 2 |
| 9 | Управленческий | 6 | 0,6 | 3,6 | 3 | 3 | 0,4 | 1,2 | 5 |
| 7 | Безопасность | 7 | 0,5 | 3,5 | 4 | 5 | 0,4 | 2 | 3 |
| 1 | Конкурентный | 5 | 0,5 | 2,5 | 5 | 3 | 0,3 | 0,9 | 7 |
| 8 | Потребительский | 8 | 0,3 | 2,4 | 6 | 6 | 0,3 | 1,8 | 4 |
| 4 | Риск потребителей | 5 | 0,4 | 2 | 7 | 3 | 0,4 | 1,2 | 6 |
| 10 | Человеческий фактор | 2 | 0,8 | 1,6 | 8 | 1 | 0,6 | 0,6 | 8 |
| 3 | Кредитный | 4 | 0,2 | 0,8 | 9 | 2 | 0,2 | 0,4 | 9 |
| 6 | Валютный | 4 | 0,2 | 0,8 | 10 | 3 | 0,2 | 0,6 | 10 |

Карта рисков после проведения мероприятий



- ❖ Основные риски сдвинулись на карте вниз и влево
- ❖ Не осталось рисков со степенью опасности выше 3,5