

Риск-менеджмент нефинансовых организаций в условиях высокой неопределенности: передовая практика и усвоенные уроки

Вебинар

6 апреля 2020 года

Выступающие



Татьяна Будишевская ●.....●
Директор
департамента
управления рисками
«Делойт», СНГ



Юрий Костенко ●.....●
Директор
по управлению
рисками
АФК «Система»



Павел Смолков ●....●
Руководитель
департамента
внутреннего контроля
и управления рисками
«Интер РАО»



Тамара Чичерюкина ●.....●
Глава отдела по
управлению рисками
Mail.ru Group



Юрий Юрченко ●.....●
Директор
по рискам и
внутреннему контролю
X5 Retail Group



Евгений Шibaев ●.....●
Начальник отдела
управления рисками
«Россети»



Николай Лузан ●....●
Директор
департамента по
управлению рисками и
внутреннему контролю
ПАО Вымпелком

Вступление

Актуальные риски

Проциклические компании

- Снижение спроса
- Снижение цен
- Снижение ликвидности



Контрциклические компании

- Повышенный спрос
- Нехватка персонала

Все компании

- Здоровье персонала
- Сбои в цепочках поставок
- Прерывание производственных операций и/или работы офиса
- Киберриски и риски, связанные с ИТ-инфраструктурой, в условиях удаленной работы
- Снижение эффективности работы персонала в условиях удаленной работы
- Отказ контрагентов от исполнения обязательств в связи с форс-мажором
- Кредитный риск
- Валютный риск

Секция 1: что было?

- ❓ Какие риски реализовались в рамках COVID-19?
- ❓ Насколько компания оказалась к ним готова? Оценивались ли аналогичные риски?
- ❓ Чем помог риск-менеджмент?
- ❓ Каких инструментов/мероприятий по управлению рисками вам не хватило?
- ❓ Как, на ваш взгляд, соотносится уровень зрелости вашей системы управления рисками с эффективностью реакции на произошедшие потрясения?

«Критически важно иметь работающий план ОНиВД, намгодились все заложенные в нем элементы».

«Пригодились все те сложные системные инструменты управления рисками, которые имеют ограниченное использование в сценарии business as usual: прогнозные модели и расчеты, сценарный анализ и стресс-тестирование, оперативный расчет метрик».

«Это реальная проверка того, риск-менеджмент в компании реальный или только на бумаге».

Секция 2: что стало?

«Все новые риски, связанные с переходом на удаленку, переводом клиентов на дистанционное обслуживание, приостановкой продаж определенных продуктов, принимаются оперативно по решению коллегиальных органов».

«В период стресса важна скорость коммуникации и точность. Участие в совещаниях на самом высшем уровне представителей функции рисков позволяет реально участвовать в управлении ситуацией».

Удастся ли поддерживать риск-ориентированный подход в текущем режиме — анализируются ли риски при принятии решений (перевод на удаленку и т. д.) или же все силы уходят на борьбу с уже наступившими рисками?

Какие риски вы видите на ближайший год? Какие меры уже принимаются (планируются к принятию)?

Секция 3: что будет?

- ❓ Каковы усвоенные уроки?
- ❓ Как изменилось ваше видение управления рисками после COVID-19?
- ❓ Какие ранее запланированные инициативы актуальны вне зависимости от текущей стрессовой ситуации?

«В отличие от теоретических анализов чувствительности, на практике негативные факторы влияют друг на друга и усиливают общий эффект».

«Реализация операционного риска может носить исключительный масштаб».

«Глобальное изменение способа коммуникации по всем каналам (B2B, B2C, ...) и изменение операционных моделей для традиционно консервативных организаций».

Заключение

Частые ошибки, которые выявляются в стрессовой ситуации



Игнорирование редких событий



Отсутствие понимания границ прочности и устойчивости бизнеса при воздействии стресс-факторов



Недооценка потенциальной силы воздействия стресс-факторов и игнорирование синергического воздействия стресс-факторов



Отсутствие учета изменений корреляционных взаимосвязей между драйверами бизнеса и структурных сдвигов



Исключение драйверов, которые ранее были стабильными и не рассматривались в качестве переменных (риск-факторов)



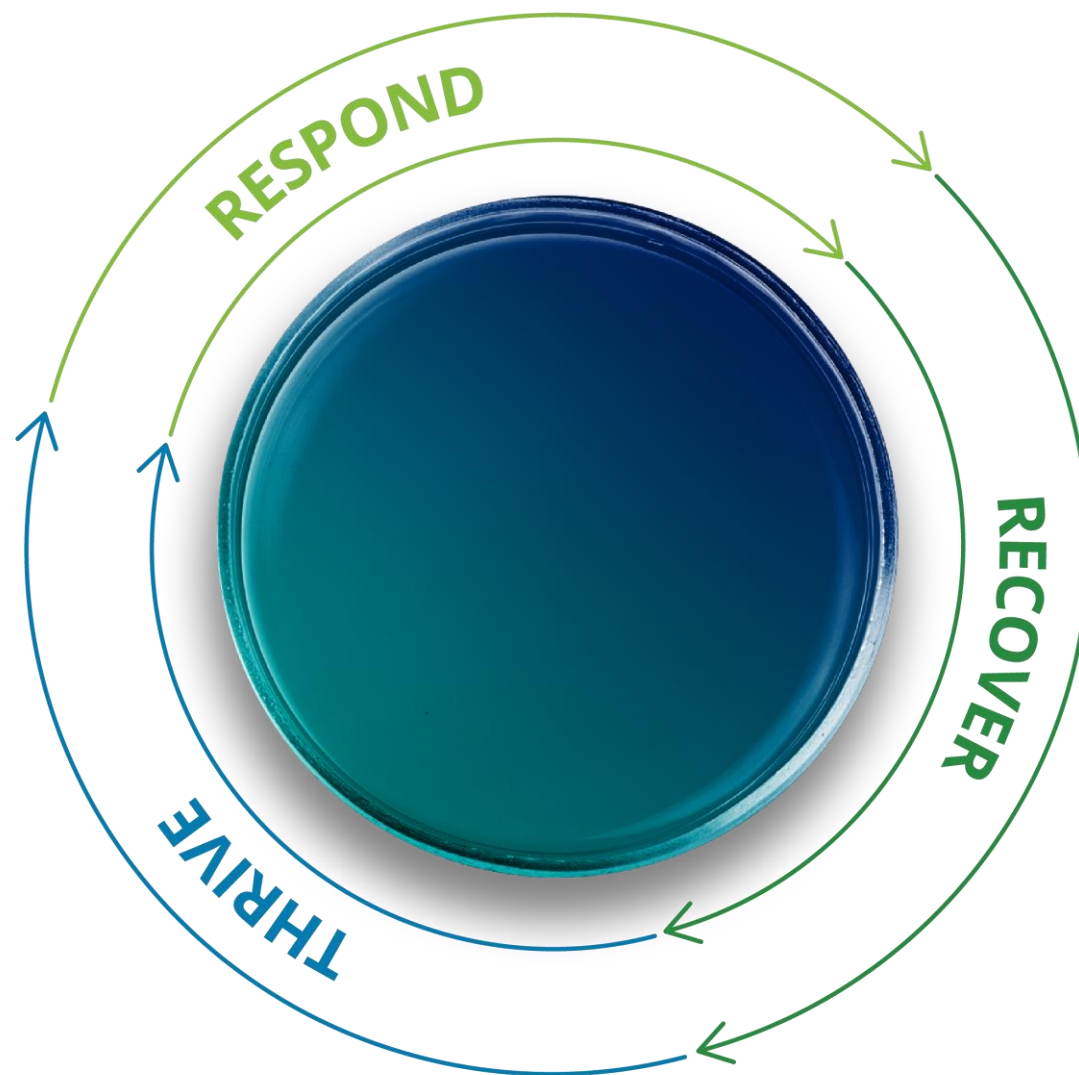
Отсутствие своевременной валидации качества моделей оценки рисков



Переоценка собственных финансовых возможностей/резервов и отсутствующие или формальные планы реагирования и антикризисного управления

Хотите узнать больше?
Все ответы — на нашем сайте

<https://www2.deloitte.com/ru/ru/pages/about-deloitte/topics/combating-covid-19-with-resilience.html>





Татьяна Будишевская

Директор Департамента управления рисками

Контактные данные:

Тел.: +7 (495) 787 06 00

Моб.: +7 (985) 202 85 33

E-mail: tbudishevskaya@deloitte.ru



Наименование «Делойт» относится к одному либо любому количеству юридических лиц, в том числе аффилированных, совместно входящих в «Делойт Туш Томацу Лимитед» (далее — «ДТТЛ»). Каждое из этих юридических лиц является самостоятельным и независимым. Компания «ДТТЛ» (также именуемая как «международная сеть «Делойт»») не предоставляет услуги клиентам напрямую. Более подробную информацию можно получить на сайте www.deloitte.com/about.

«Делойт» является ведущей международной сетью компаний по оказанию услуг в области аудита, консалтинга, финансового консультирования, управления рисками и налогообложения, а также сопутствующих услуг. «Делойт» ведет свою деятельность в 150 странах, в число клиентов которой входят около 400 из 500 крупнейших компаний мира по версии журнала Fortune. Около 312 тысяч специалистов «Делойта» по всему миру привержены идеем достижения результатов, которыми мы можем гордиться. Более подробную информацию можно получить на сайте www.deloitte.com.

Настоящее сообщение содержит исключительно информацию общего характера. Ни компания «Делойт Туш Томацу Лимитед», ни входящие в нее юридические лица, ни их аффилированные лица не предоставляют посредством данного сообщения каких-либо консультаций или услуг профессионального характера. Прежде чем принять какое-либо решение или предпринять какие-либо действия, которые могут отразиться на вашем финансовом положении или состоянии дел, проконсультируйтесь с квалифицированным специалистом. Ни одно из юридических лиц, входящих в международную сеть «Делойт», не несет ответственности за какие-либо убытки, понесенные любым лицом, использующим настоящую публикацию.