

Принципы и подходы АО «Шардаринская ГЭС» в области управления рисками

Деятельность АО «Шардаринская ГЭС» характеризуется объективными проблемами, связанными с высокой степенью морального и физического износа оборудования, низкорентабельными активами, ростом цен на энергоносители, ужесточением экологических требований, неблагоприятной законодательной базой в электроэнергетике и др. В связи с этим, в системе корпоративного управления большое значение придается системе управления рисками. Внедрение и совершенствование системы управления рисками – одна из важнейших задач и необходимое условие достижения стратегических и операционных целей АО «Шардаринская ГЭС».

В АО «Шардаринская ГЭС», в рамках внедрения системы управления рисками, действуют следующие внутренние документы:

- 1) Политика управления рисками;
- 2) Правила идентификации и оценки рисков;
- 3) Правила управления риском потери ликвидности в АО «Шардаринская ГЭС»;
- 4) Правила управления процентным риском;
- 5) Правила управления валютным риском;
- 6) Методика разработки ключевых рискованных показателей.

Основными принципами процесса управления рисками в АО «Шардаринская ГЭС» являются:

- 1) целостность – рассмотрение элементов совокупного риска группы АО «Шардаринская ГЭС» в разрезе корпоративной системы управления рисками;
- 2) открытость – запрет на рассмотрение корпоративной системы управления рисками как автономной или обособленной;
- 3) структурность – комплексная система управления рисками имеет четкую структуру;
- 4) информированность – управление рисками сопровождается наличием объективной, достоверной и актуальной информации;
- 5) непрерывность – процесс управления рисками осуществляется на постоянной основе;
- 6) цикличность – процесс управления рисками представляет собой постоянно повторяющийся выстроенный цикл его основных компонентов.

В рамках развития системы управления рисками, АО «Шардаринская ГЭС» проводит работу по внедрению единых методов, способов и подходов управления рисками группы компаний АО «Самрук-Энерго».

Система управления рисками в АО «Шардаринская ГЭС» подразумевает установление и развитие необходимой инфраструктуры и культуры, а также охватывает применение логических и систематических методов идентификации, анализа и оценки, мониторинга, контроля и управления рисками, по всем направлениям деятельности, функциям или процессам, осуществляемым в АО «Шардаринская ГЭС», в целях предотвращения потерь и максимизации выгоды.

При идентификации рисков АО «Шардаринская ГЭС» опирается на мировой опыт, сравнение с аналогичными компаниями отрасли, экспертную оценку с привлечением собственных и внешних экспертов.

В связи с этим, АО «Шардаринская ГЭС» ежегодно осуществляются необходимые мероприятия по управлению рисками, согласно внутренним документам АО «Шардаринская ГЭС».

Во исполнение Политики управления рисками, АО «Шардаринская ГЭС» ежегодно или по мере необходимости устанавливает альтернативные пути достижения своих целей и определяет риски, связанные с такими альтернативами или событиями, которые могут влиять на достижение целей. В связи с этим, в АО «Шардаринская ГЭС» на каждый предстоящий год утверждаются карта рисков, регистр рисков, ключевые рисковые показатели и план мероприятий по управлению ключевыми рисками. Руководствуясь этими документами АО «Шардаринская ГЭС» осуществляет необходимую работу.

Таким образом, АО «Шардаринская ГЭС» определяет следующие категории рисков:

- стратегические;
- финансовые;
- операционные (производственные);
- правовые.

Учитывая высокую изношенность основного технологического оборудования, в АО «Шардаринская ГЭС» большое значение имеет обеспечение надежности работы энергооборудования и в целом обеспечение бесперебойности энергоснабжения экономики. В целях минимизации технологических рисков в АО «Шардаринская ГЭС» осуществляется постоянный мониторинг уровня надежности основного и вспомогательного оборудования и вероятности возникновения технологических нарушений, реализуются программы, направленные на модернизацию действующего оборудования.

В целях минимизации риска неблагоприятных изменений нормативно-правовой базы, АО «Шардаринская ГЭС» принимает участие в разработке и экспертизе проектов нормативно-правовых актов, в том числе через участие в отраслевых ассоциациях.

Существенное внимание в АО «Шардаринская ГЭС» уделяется риску возникновения несчастного случая на производстве. На постоянной основе осуществляются обучение персонала вопросам охраны труда, повторные и внеплановые инструктажи, предсменное медицинское освидетельствование и медицинские осмотры. На выполнение всех этих мероприятий в бюджете АО «Шардаринская ГЭС» предусматриваются необходимые средства.

АО «Шардаринская ГЭС» отмечает подверженность валютному риску, связанному с привлечением долгосрочных займов, в том числе для реализации инвестиционных проектов. В целях снижения влияния валютного риска, 18.12.2015 г. заключен Инвестиционный договор №3 от между АО «Шардаринская ГЭС», Министерством энергетики Республики Казахстан и Департаментом Комитета по регулированию естественных монополий и защите конкуренции

Министерства национальной экономики Республики Казахстан по Южно-Казахстанской области, на расчетный тариф за электроэнергию с 1 января 2016 года.

В рамках управления валютным риском, АО «Шардаринская ГЭС» на постоянной основе осуществлялись следующие мероприятия:

- заключение договоров в национальной валюте;
- своевременное рефинансирование займов в иностранной валюте (по мере возможности);
- мониторинг изменения валютных курсов EUR/KZT;
- мониторинг валютной позиции, формирование и предоставление своему акционеру (АО «Самрук-Энерго») отчета о величине валютного риска.

С целью контроля валютного риска при управлении временно свободными деньгами, АО «Шардаринская ГЭС» контролирует уровень временно свободных денежных средств, выраженных в тенге и иностранных валютах.

Основные результаты и выводы процесса управления рисками в АО «Шардаринская ГЭС» отображаются в регулярно утверждаемой Советом директоров АО «Шардаринская ГЭС» ежеквартальной отчетности по рискам и мероприятиям по реагированию на них, формируемой в АО «Шардаринская ГЭС» подразделениями – владельцами рисков и должностным лицом, ответственным за управление рисками.