

# Corporate education risk management model

Dmitry Lapin,  
*Ph.D., PRM, AT 31000,*  
*Head of Educational Project Management Department*  
*Moscow Branch of Gazprom Corporate Institute* *Москва*

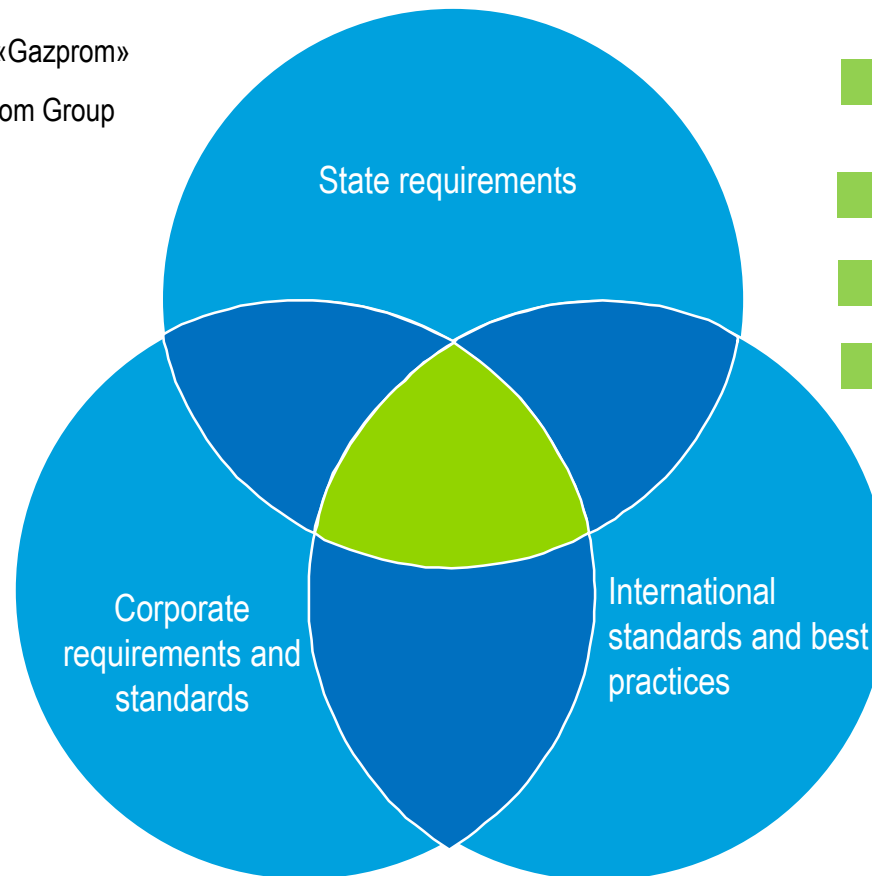
# Corporate system of risk management and internal control

## Corporate requirements and standards

- Policy of corporate risk management and internal control PJSC «Gazprom»
- Regulation of system of management of operational risks Gazprom Group
- Regulation of system of management of credit risks of PJSC «Gazprom» its subsidiaries and organizations
- Regulation of system of management of currency, interest rate and liquidity risk of Gazprom Group
- Methodological documents for risk management and internal control
- Corporate standards for risk management and internal control

## International standards and best practices

- COSO ERM
- ISO 31000
- FERMA
- GOST R 31000
- Basel Committee Principles and Approaches (Basel II, III)

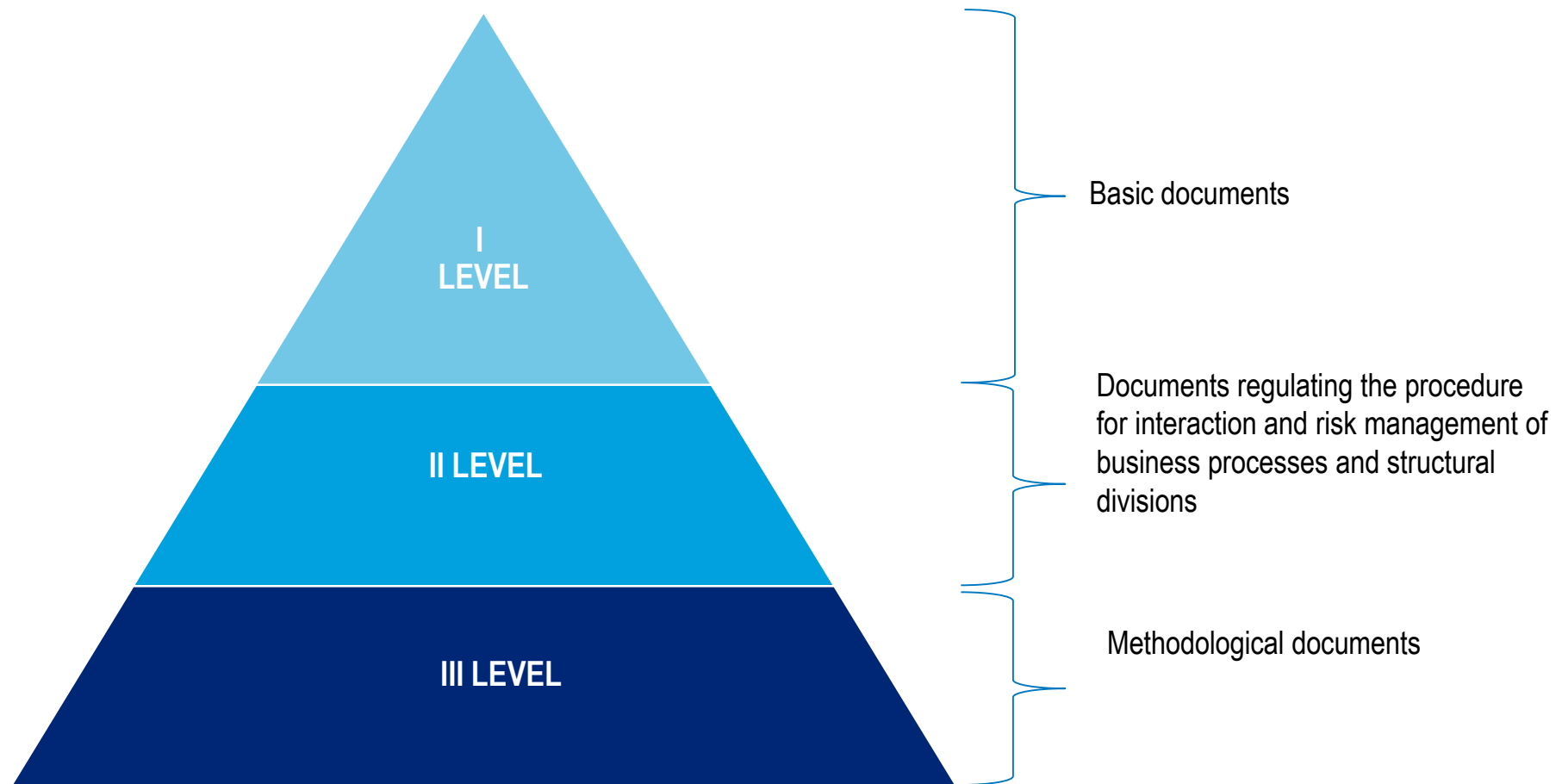


## State requirements

- Federal law 19.07.2018 N 209-ФЗ concerning JSCs
- President of Russian Federation instructions and Government directives
- Federal Agency for State property management documents
- Central bank of Russian Federation documents: Corporate governance code.



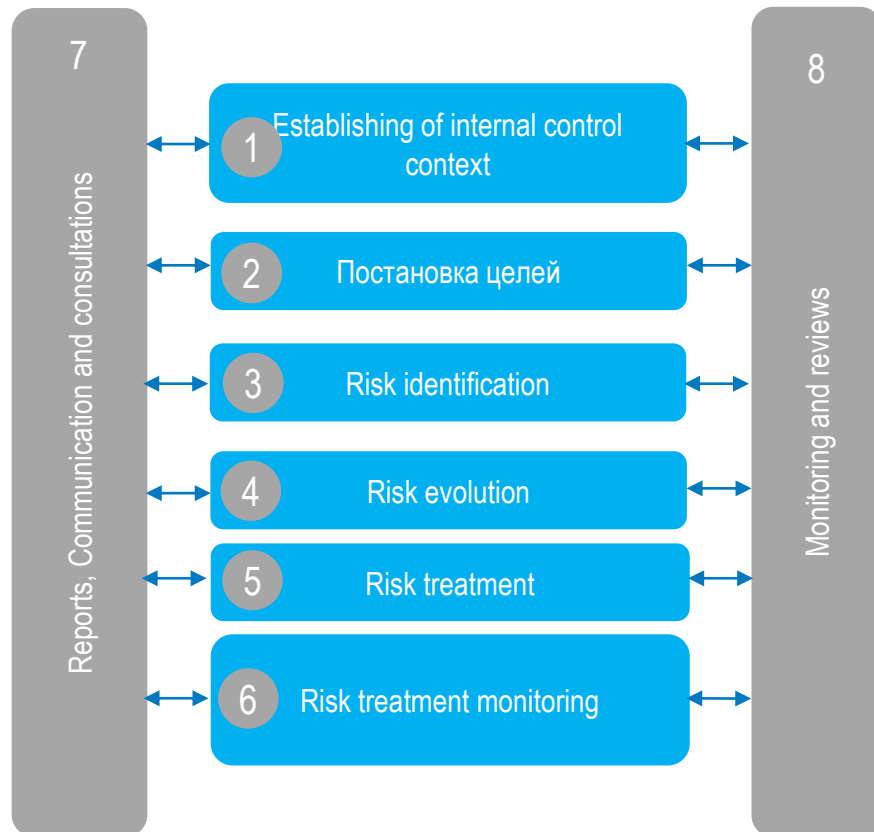
# Risk management documentation structure



# Policy of corporate risk management and internal control of Gazprom corporate institute



# Risk management process in Gazprom corporate institute



## External risk factors

- changes in legislation of Russian federations, including additional professional education
- emergency situations and unfavorable epidemiological situation
- reduce of training costs

## Internal risk factors

- technical device failure and IT systems
  - internal control system imperfection
  - organization system imperfection (functions, powers, responsibilities)
  - employee's violation of established requirements and procedures
  - Insufficient level of qualification
- 
- Insufficient level of quality provided by teachers and external providers
  - случайные или преднамеренные действия физических и (или) юридических лиц, направленные против интересов Института
  - natural hazards, disasters.

Оценка уровней последствий возникновения рисков

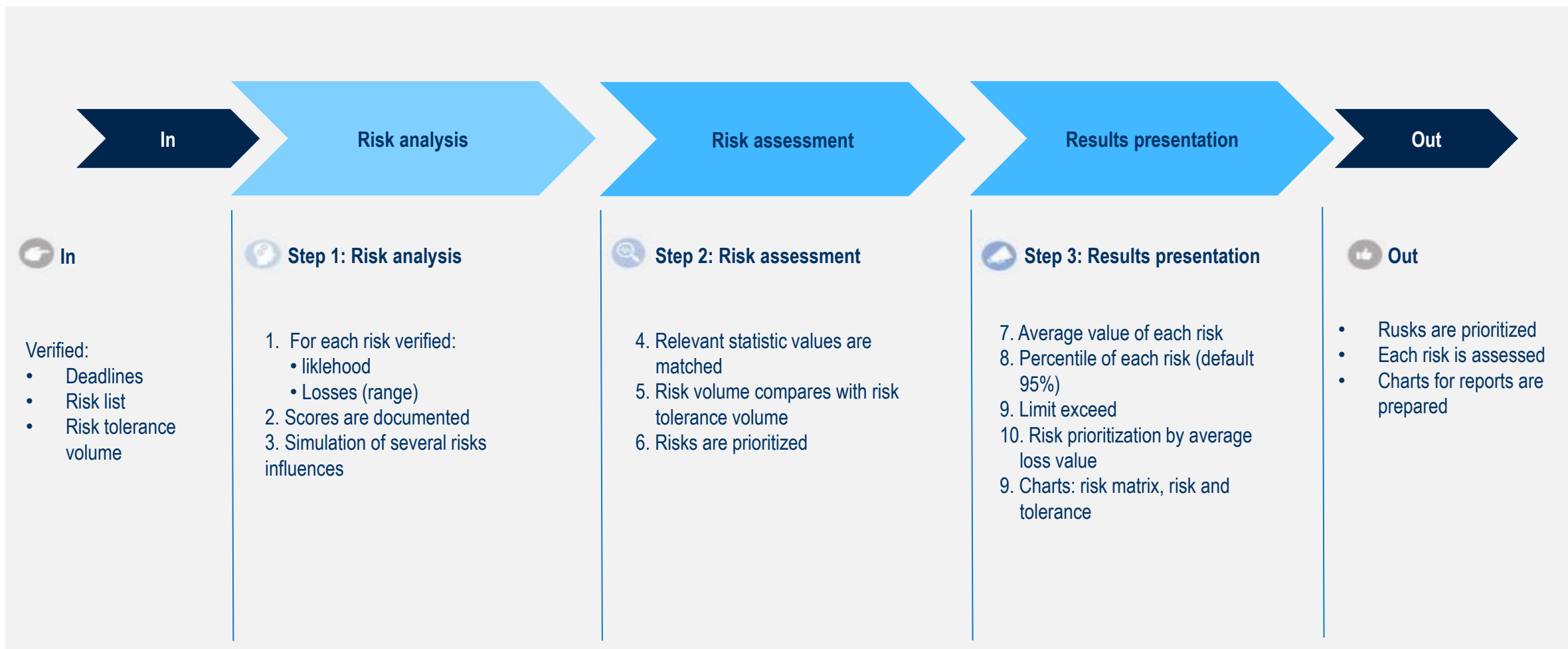
Risk assessment methods

Key efficiency criteria

Score	1	2	3	4	5
Expert assessment	Extremely low	low	middle	high	extremely high
Costs budget	insignificant	< 10 %	10–20 %	20–40 %	> 40 %
Meet Deadline	insignificant	< 5 %	5–10 %	10–20 %	> 20 %
Content	insignificant	Minor part of the program changed	Major part of the program changed	Content change is unacceptable	Full program is unacceptable
Educational projects quality	insignificant	< 5 %	5–10 %	10–20 %	> 20 %

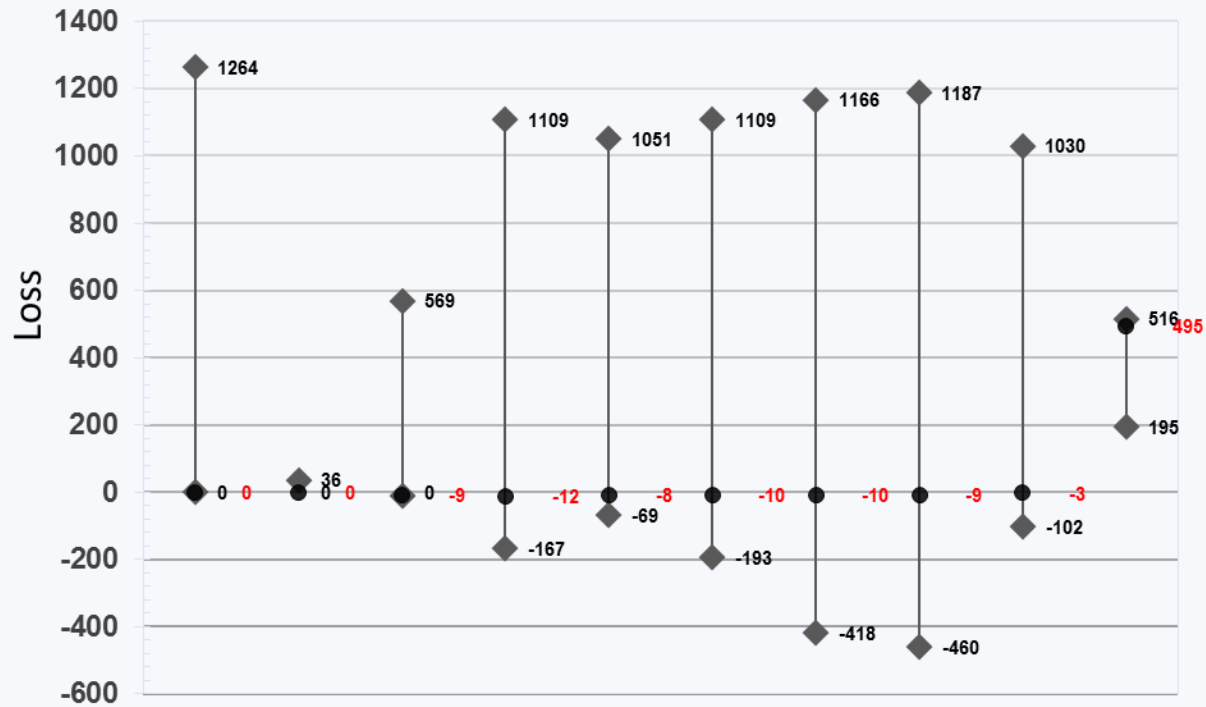
- Expert assessment
- Scenario analysis
- Simulation

Resource: created by author according to local risk management regulations of Gazprom corporate institute.



# Risk simulation

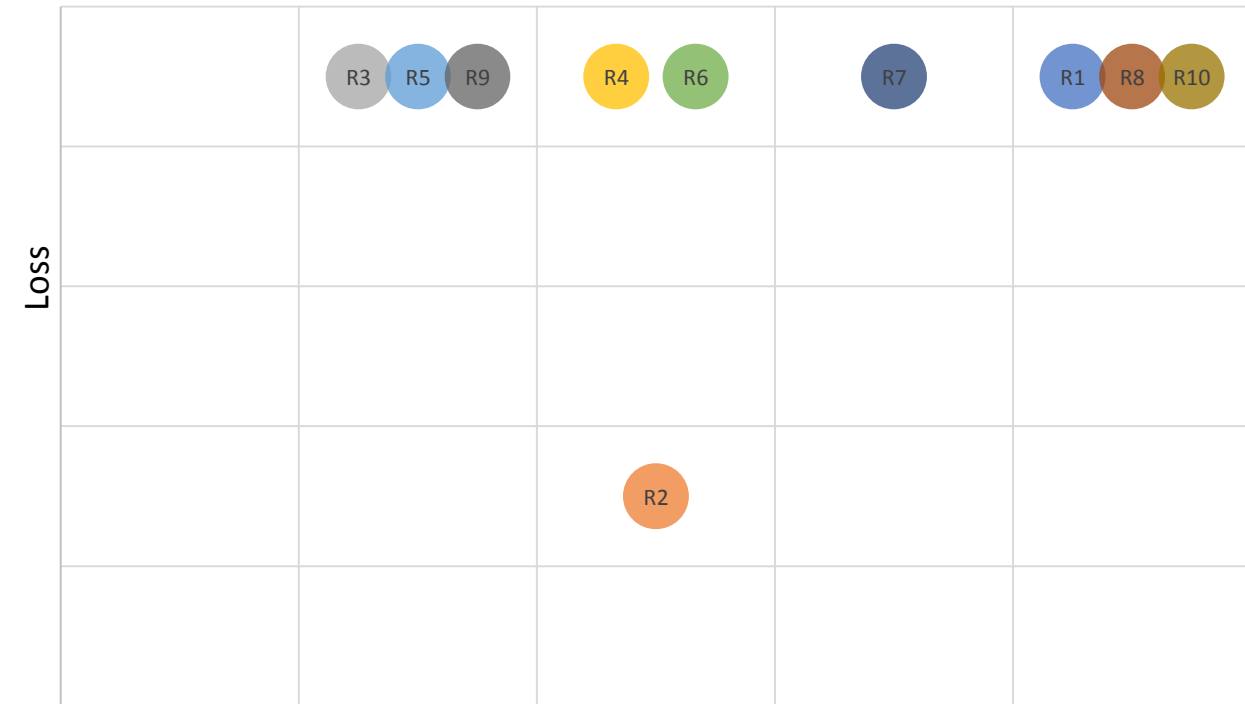
Risks and tolerance



Lower value - 5% percentile

Upper value - 95% percentile

Risk matrix

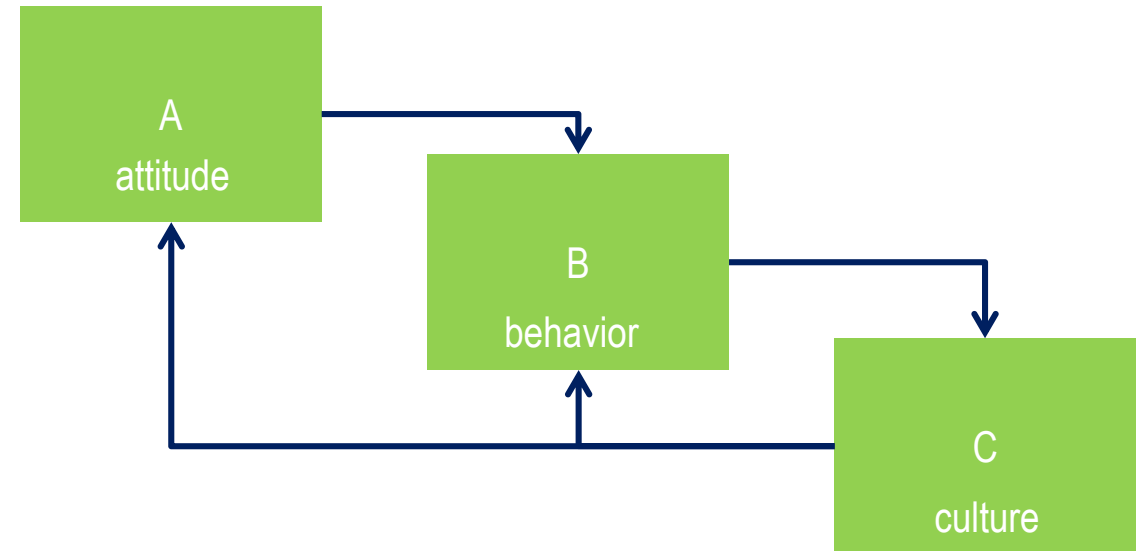


Likelihood



# Corporate risk management culture

*Whatever good or simple the process of risk management could be, if employees and management refuse it, company will not manage risks.*



A-B-C Model (IRM – Institute of Risk Management)

# Risk management competences development system



**186**  
subsidiaries  
and  
organizations

**>5000**  
Gazprom  
employees

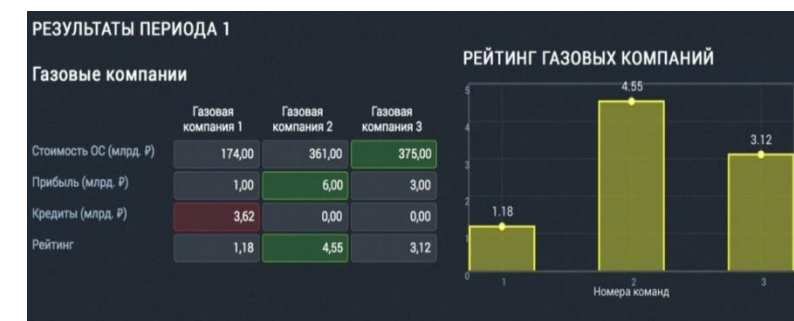
**125**  
Educational  
events

## Training structure and competence development levels

4. Expert	Professional risk-manager – PRM (4 modules)		Webinars	Digest
3. Experience / Master	Financial and credit risk management	Operational risk management		
2. Knowledge	Professional risk-management in oil and gas industry	Risk management in accordance with ISO 31000		
1. Awareness	E-learning «Risk management in PJSC «Gazprom»			

Resource: created by author according to local risk management regulations of Gazprom corporate institute.

# Business simulation «Gas company management»



**ПРОДАЖА**

Компания	Планируемый объем, млрд. м³	Ценовой диапазон, руб./м³	Объем рынка, млрд. м³	Равновесная цена рынка, руб./м³	Объем сделок, млрд. м³
Газовая компания 1	100,00	10 024,00 ÷ 10 000,00	1 024,00	1 024,00 ÷ 1 005,00	1 024,00
Газовая компания 2	200,00	10 024,00 ÷ 10 000,00			1 024,00
Газовая компания 3	50,00	100 240,00 ÷ 100 000,00			0,00
Газовая компания 4	14,00	10 024,00 ÷ 10 000,00			1 024,00
Газовая компания 5	99,00	10 024,00 ÷ 10 000,00			1 024,00

**ПОКУПКА**

Компания	Планируемый объем, млрд. м³	Ценовой диапазон, руб./м³	Объем рынка, млрд. м³	Равновесная цена рынка, руб./м³	Объем сделок, млрд. м³
Газовая компания 1	100,00	10 024,00 ÷ 10 000,00	1 024,00	1 024,00 ÷ 1 005,00	1 024,00
Газовая компания 2	200,00	10 024,00 ÷ 10 000,00			1 024,00
Газовая компания 3	50,00	100 240,00 ÷ 100 000,00			0,00
Энергетическая компания 1	14,00	10 024,00 ÷ 10 000,00			1 024,00
Энергетическая компания 3	99,00	10 024,00 ÷ 10 000,00			1 024,00



HR

T&D  
Recruitment and firing



Sales

Exchange trade,  
Long-term contracts



Finance

Cash flows



Processing and storage

Production volume  
Products type




Extraction

Deposits

Resource: created by author according to local risk management regulations of Gazprom corporate institute.

# Дайджест и электронный курс по управлению рисками



МОСКВА  
САНКТ-ПЕТЕРБУРГ  
МОСКОВСКАЯ ОБЛАСТЬ

RU

ОБ ИНСТИТУТЕ ОБУЧЕНИЕ НОВОСТИ БИБЛИОТЕКА КОНСАЛТИНГ КОНТАКТЫ




Главная / Консалтинг / Исследования / Управление рисками

Исследования

Управление рисками

Контакты

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ






Культура управления рисками

Представление в вопросах

Новая версия стандарта

Новая версия стандарта



МОСКВА  
САНКТ-ПЕТЕРБУРГ  
МОСКОВСКАЯ ОБЛАСТЬ

ОБ ИНСТИТУТЕ ОБУЧЕНИЕ НОВОСТИ

Главная / Консалтинг / Исследования / Управление рисками / Культура управления рисками-важный аспект эффективного риск-ориентированного управления в компании

Исследования

Управление рисками

Контакты

## КУЛЬТУРА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ-ВАЖНЫЙ АСПЕКТ ЭФФЕКТИВНОГО УПРАВЛЕНИЯ В КОМПАНИИ.

**Здравствуйте, уважаемые коллеги!**

Мы вернулись к Вам в Новом году с продолжением тематических обзоров.

В прошлом обзоре мы затронули очень важный аспект эффективного управления рисками - культуры риск-менеджмента.

Это многофакторное понятие, которое включает: понимание рисков в бизнес-процессах, инфраструктуру и процедур риск-менеджмента, документов и процесса обмена информацией, ряд других. В любом другом деле очень важен не только набор документов и процедур, а их правильная трактовка и применение. А это уже во многом определяется уровнем зрелости компании, уровнем развития корпоративной культуры.


Мы далеко не единственная компания в России, которая применяет риск-ориентированные подходы в управлении. Для сегодняшнего обзора мы проанализировали опыт (положительный и не очень) коллег из других компаний, внедрению управления рисками и сделаем определенные полезные практические выводы.

Поделимся опытом и наблюдениями мы попросили **Директора департамента анализа и управления рисками АО "ОСК"** (Объединенная страховая компания), независимого эксперта по оценке профессиональных квалификаций по профессиональным квалификациям финансового рынка по специальности "управление рисками" Коваленко:

- Антон, от компании к компании мы часто видим весьма интересную ситуацию, когда, несмотря на общепринятые подходы по управлению рисками в международных или российских стандартах, в компаниях складывается очень индивидуальная ситуация с управлением рисками и с самим отношением к рискам. На Ваш взгляд, это обусловлено?

- Попробую начать вот с такого примера. Одна из компаний, где мне довелось работать в качестве приглашенного консультанта по внедрению риск-менеджмента, является дочерним обществом и входит в Группу компаний. Спonsorом внедрения управления рисками выступали директор по качеству и структуры, находящиеся в ведении. И поскольку процессы были уже в значительной степени отлажены, управление рисками стало естественным продолжением уже сложившейся системы. Большая часть работников не знала теории риск-менеджмента, но воспринимала новые знания позитивно, открыто, поскольку сама идеология риск-менеджмента близка к системам менеджмента, заложенным в международных стандартах, можно сказать, ею же и являясь. И поскольку процессы были уже в значительной степени отлажены, управление рисками стало естественным продолжением уже сложившейся системы. Большая часть работников не знала теории риск-менеджмента, но воспринимала новые знания позитивно, открыто, поскольку сама идеология риск-менеджмента близка к системам менеджмента, заложенным в международных стандартах, можно сказать, ею же и являясь. И поскольку процессы были уже в значительной степени отлажены, управление рисками стало естественным продолжением уже сложившейся системы. Большая часть работников не знала теории риск-менеджмента, но воспринимала новые знания позитивно, открыто, поскольку сама идеология риск-менеджмента близка к системам менеджмента, заложенным в международных стандартах, можно сказать, ею же и являясь.


Итак, риск-менеджмент является подходом к управлению и принятию решений. Компания сама себе поставила амбициозную задачу, и все наше время совместной работы мы детально разбирались, как можно претворить ее в жизнь. Основные моменты, которые требуют головная, материнская компания, участники обучающей программы "схватили" быстро и задавали вопросы уже по более продвинутым методам работы с рисками, которые позволяют



МОСКОВСКАЯ ОБЛАСТЬ

СОО. Управление рисками организаций. Интегрированная модель.

СОО ERM 2017 – Структура концепции



Управление и культура

Стратегия и постановка целей

Эффективность деятельности

1. Осуществление советом директоров надзорной функции за управлением рисками
2. Создание операционных структур
3. Определение желаемой культуры
4. Демонстрация приверженности основным ценностям
5. Привлечение, развитие и удержание квалифицированных специалистов
6. Анализ условий ведения деятельности
7. Определение риск-аппетита
8. Оценка стратегических альтернатив
9. Формулировка бизнес-целей
10. Выявление рисков
11. Оценка влияния рисков
12. Приоритизация рисков
13. Реагирование на риск
14. Комплексный взгляд на риск



МОСКОВСКАЯ ОБЛАСТЬ

ISO 31000. Структура управления рисками - 2018



Лидерство и ответственность

Планирование

Выявление

Разработка

Оценка

Реализация

- признания и выполнения всех своих обязательств, в том числе добровольных;
- установления величины и типа рисков, которые организация может или не может принять;
- доведения до сведения заинтересованных сторон информации о ценности риск-менеджмента;
- обеспечения мониторинга рисков;
- обеспечения соответствия структуры риск-менеджмента контексту организации.

Thank you for your attention!