



24 — 27 апреля  
Москва, Цифровое деловое  
пространство, ул. Покровка, 47

# Риск-менеджмент и управление проектами ГЧП: российский и зарубежный опыт





**Алексей Сидоренко**  
CRMP.RR, CT31000

- **14 лет в управлении рисками** в Австралии, Польше, Казахстане и России
- **10 лет преподавания в области риск-ориентированного принятия решений** в рамках MBA, Executive MBA и корпоративных университетов Газпром, Роснефть, РЖД (Победитель в номинации лучший курс по рискам в 2013, 2014, 2015)
- Автор и преподаватель курсов по **национальной и международной сертификации по управлению рисками** в России и СНГ
- **Лучшее внедрение УР** в России в 2014
- **Лучший риск менеджер 2014 года**
- Разрабатывал методологии по рискам для PwC, Счетной Палаты и Australian Stock Exchange
- **Опубликовал 3 книги** по управлению рисками

**В контексте государственно-частных проектов управление рисками имеет достаточно широкое определение и применение. Для целей данной дискуссии мы выбрали несколько наиболее актуальных тем...**



Привлечение  
финансирования и  
оценка рисков  
проекта  
инвесторами



Структурирование  
проекта и  
распределение  
ответственности за  
риски участниками

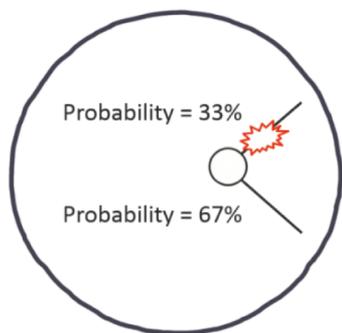


Нивелирование  
рисков в процессе  
реализации проекта  
и мониторинг  
рисков проекта

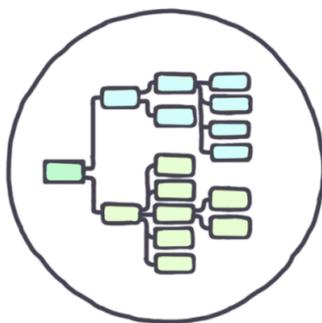
...проблема заключается в том, что инструменты, используемые в России для анализа рисков ГЧП, не способствуют эффективному управлению...

**...почему участники ГЧП в России продолжают их использовать остается загадкой... сегодня, даже планшеты обладают достаточной вычислительной мощностью для полноценного анализа рисков**

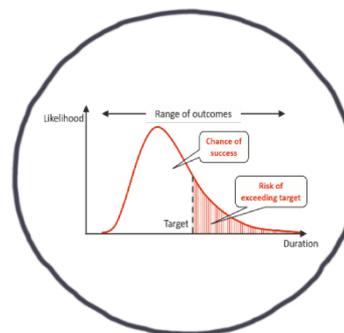
# Наиболее эффективный способ избежать ментальных ловушек и недостатков, присущих традиционным экспертным способам оценки рисков, можно через:



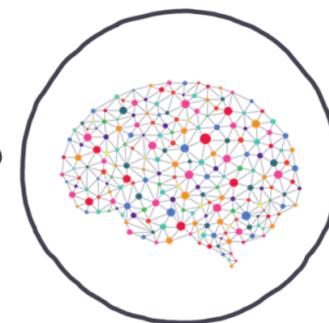
1. Моделирование отдельных событий



2. Моделирование WBS

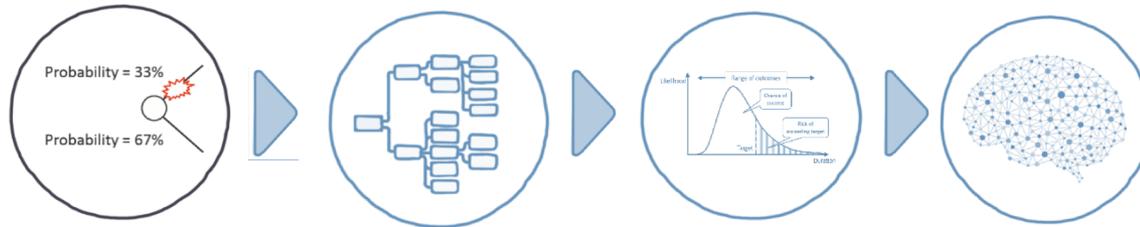


3. Моделирование факторов риска



4. Использование искусственного интеллекта / теории сложности

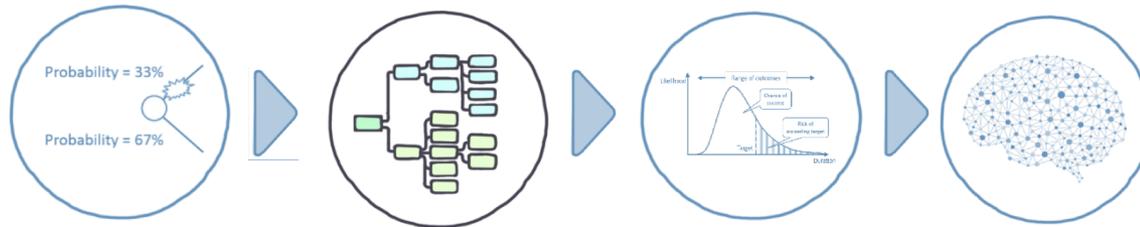
# 1. Моделирование отдельных событий



Наиболее простой вариант это моделирование отдельных событий, которые могут произойти и оказать влияние на стоимость, качество или сроки реализации ГЧП

- Требуется выявления событий, многие из которых могут быть непредсказуемыми
- Плохо учитывает взаимосвязи между элементами проекта
- Максимально упрощенный анализ рисков, не позволяет определить общий уровень риска проекта

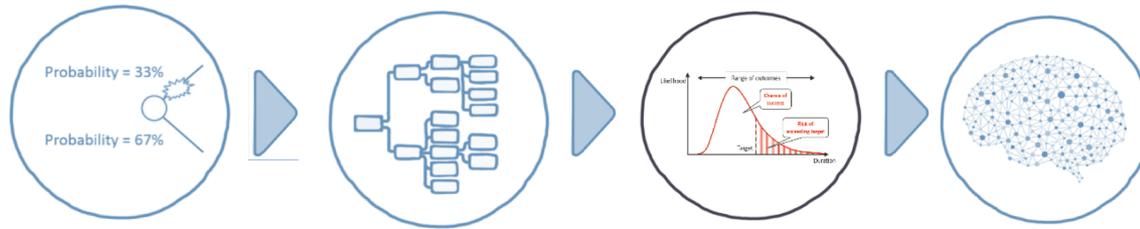
## 2. Моделирование WBS



Более продвинутый вариант - моделирование не отдельных событий, а наложение волатильности на все ключевые строки плана реализации ГЧП

- Плохо учитывает корреляцию между элементами проекта
- Часто результат показывает заниженный уровень риска, так как взаимосвязи между рисками тяжело учитываются
- Слабо способствует реализации мероприятий по управлению рисками

### 3. Моделирование факторов риска

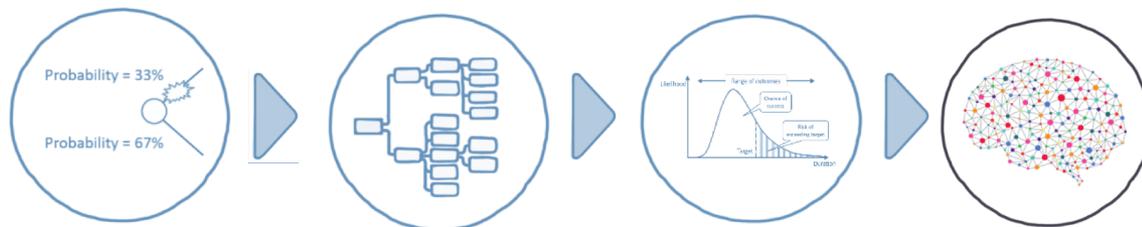


Наиболее оптимальный метод это моделирование факторов риска – наложение волатильности на ключевые допущения ГЧП, определение взаимосвязей и оценка общей рискованности проекта

- Достаточно легко в использовании и объяснении пользователям модели
- Позволяет учитывать корреляцию между рисками
- Использует имитационное моделирование для оценки ключевых параметров ГЧП с учетом рисков



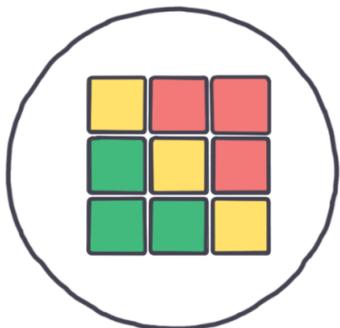
## 4. Использование искусственного интеллекта / теории сложности



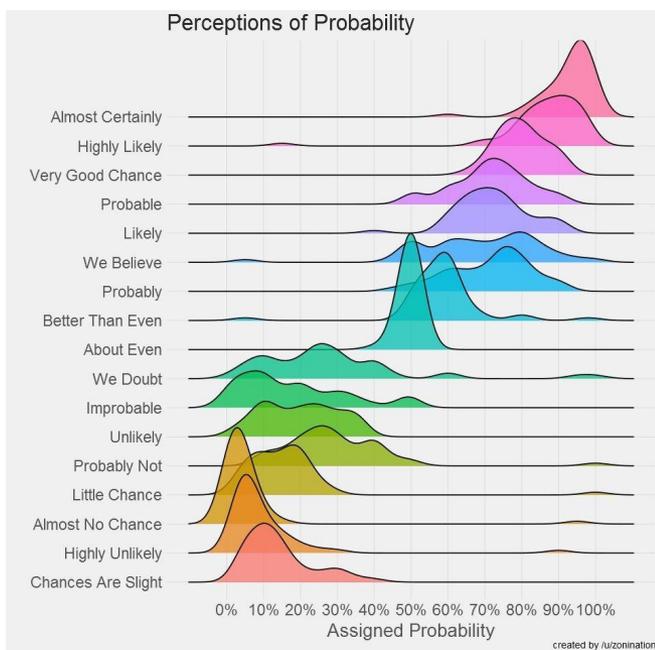
В будущем использование искусственного интеллекта и теории сложных систем позволит более точно планировать проекты, распределять ответственность за риски и принимать решения по нивелированию наиболее существенных рисков.

### С ЧЕГО НАЧАТЬ?

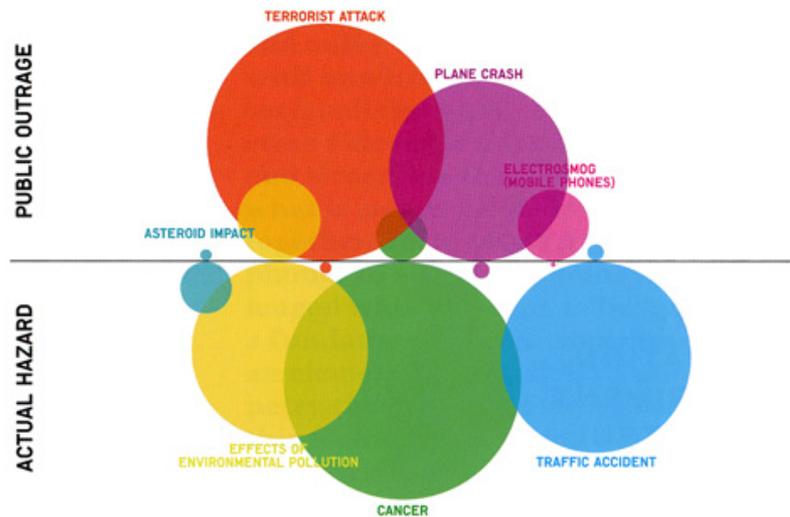
- Создание структуры / **повышение квалификации специалистов**, ответственных в оценку рисков
- **Вовлечение ключевых участников ГЧП** для анализа рисков с целью определения справедливой цены, распределения рисков и мероприятий по их управлению
- Использование инструментов управления рисками **для принятия ключевых решений в ходе реализации проекта**



# А как же всем хорошо знакомые матрицы рисков? Разве это не риск менеджмент?



## RISK PERCEPTION AND ACTUAL HAZARDS



**Вопросы?**

