

АДАПТИВНОСТЬ БИЗНЕСА К НОВЫМ УСЛОВИЯМ: ПРИНЦИПЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ТИПА «ЧЁРНЫХ ЛЕБЕДЕЙ»

Килячков А.А., компания «EY»
Чалдаева Л.А., Финансовый университет
при Правительстве Российской Федерации
Килячков А.А., МГИМО (Университет)

02 декабря 2016 г.



Building a better
working world

Цель выступления

- 1. Определиться в понятии риска типа «чёрного лебедя».**
- 2. Сформулировать основные принципы управления рисками типа «чёрного лебедя».**
- 3. Предложить необходимые действия, которые следует совершить для управления рисками типа «чёрного лебедя» при подготовке к выпуску новой продукции.**

Риск менеджмент в системе комплаенс

1. Организационно-штатные мероприятия
2. Нормативно-правовые мероприятия
3. Риск-менеджмент
4. Мониторинг, контроль и оценка эффективности

Организационная структура комплаенс	ИТ-структура комплаенс	Эксперты и контролёры
Комплаенс-политики и процедуры	Бизнес-культура, обучение и коммуникации	Отчётность
Распределение ответственности среди руководства	Оценка рисков и построение карты рисков	Методология комплаенса и риск-менеджмента
Проверка и оценка эффективности комплаенс	Комплаенс-контроли бизнес-процессов	Мониторинг изменения законодательства
<i>Объекты регулирования</i>		
<i>Бухгалтерский учёт и отчётность</i>	<i>Налогообложение</i>	<i>Трудовые отношения</i>
<i>Регулирование в сфере корпоративного права</i>	<i>Противодействие коррупции</i>	<i>Бизнес-процессы</i>

Традиционная методика управления рисками



Что такое риск типа «чёрного лебедя»?

Это вид рисков, который сопровождается событиями, которые характеризуются следующими признаками:

- 1. Отсутствие предыстории** - в прошлом не было зафиксировано признаков, предвещающих наступление этого события и зачастую до реализации данного события вероятность его появления, рассматривалась как бесконечно малая величина или не рассматривалось вовсе.
- 2. Катастрофичность результатов** наступления события - наступившее событие приводит к огромным, порой катастрофическим последствиям. Если произошедшие события предоставляют шанс, то блестящие перспективы.
- 3. Ретроспективная объяснимость произошедшего** - после того, как это событие произошло, возникают различные объяснения произошедшего, которые делают данное неожиданное событие объяснимым и предсказуемым.

Примеры рисков типа «чёрного лебедя»

- Победа Дональда Трампа на выборах Президента США.
- Результаты Brexit о выходе Великобритании из ЕС.
- События на Украине в 2014 г. и последовавшие за этим секторальные санкции против России (риск и возможность).
- Снижение цен на нефть, происходящее с июня 2014 г.
- Духи Шанель № 5, появление которых стало результатом ошибки лаборанта (реализованная возможность).
- Появление смартфонов компанией Apple стало возможным благодаря широкому распространению мобильной связи.
- Samsung со своими самовоспламеняющимися смартфонами.
- При зарождении кибернетики советскими учёными рассматривалась возможность использования троичной системы счисления в качестве основы вычислительных процессов (нереализованная возможность).

«Маленькие хитрости» Насима Талеба

- **Умейте отличать** «хорошие» случайности (назовём их «синими птицами») от «плохих» («чёрных лебедей»).
- **Не гонитесь за точностью прогнозирования** и конкретикой выводов. Нужно быть готовым к любым неожиданностям.
- **Хватайтесь за любую возможность** или за то, что на неё похоже.
- **Остерегайтесь детально разработанных государственных планов.** Цель чиновников при разработке планов не совпадает с той целью, которая должна быть заложена в этих планах.
- **Не тратьте время на споры с прогнозистами и аналитиками.** Чем длительнее прогноз, тем меньше на него можно положиться.

Принципы управления рисками типа «чёрного лебедя»

- Проектирование**
- Цели – реальные
 - Затраты – адекватны целям
 - План – адаптивный
 - Резервы предусмотрены планом

- Реализация**
- Цель достигается поэтапно, каждый этап приближает к конечной цели
 - Каждый этап предоставляет различные варианты дальнейших действий
 - Следует выбирать наименее очевидный вариант
 - Не следует повторять неудачные варианты
 - Затраты минимизируем пока продвигаемся к цели

Основная идея предлагаемого подхода

Идея



Управление рисками типа «чёрного лебедя» предполагает такую **организацию производственного процесса**, которая, исходно не являясь экономически оптимальной, при реализации риска типа «чёрного лебедя» **не испытывает катастрофических финансово-экономических последствий.**



Задача



Необходимо понять, **каким образом эти особенности должны быть интегрированы в производственную деятельность** предприятий реального сектора экономики и гармонизированы с нею.

«Дорожная карта» достижения поставленной цели

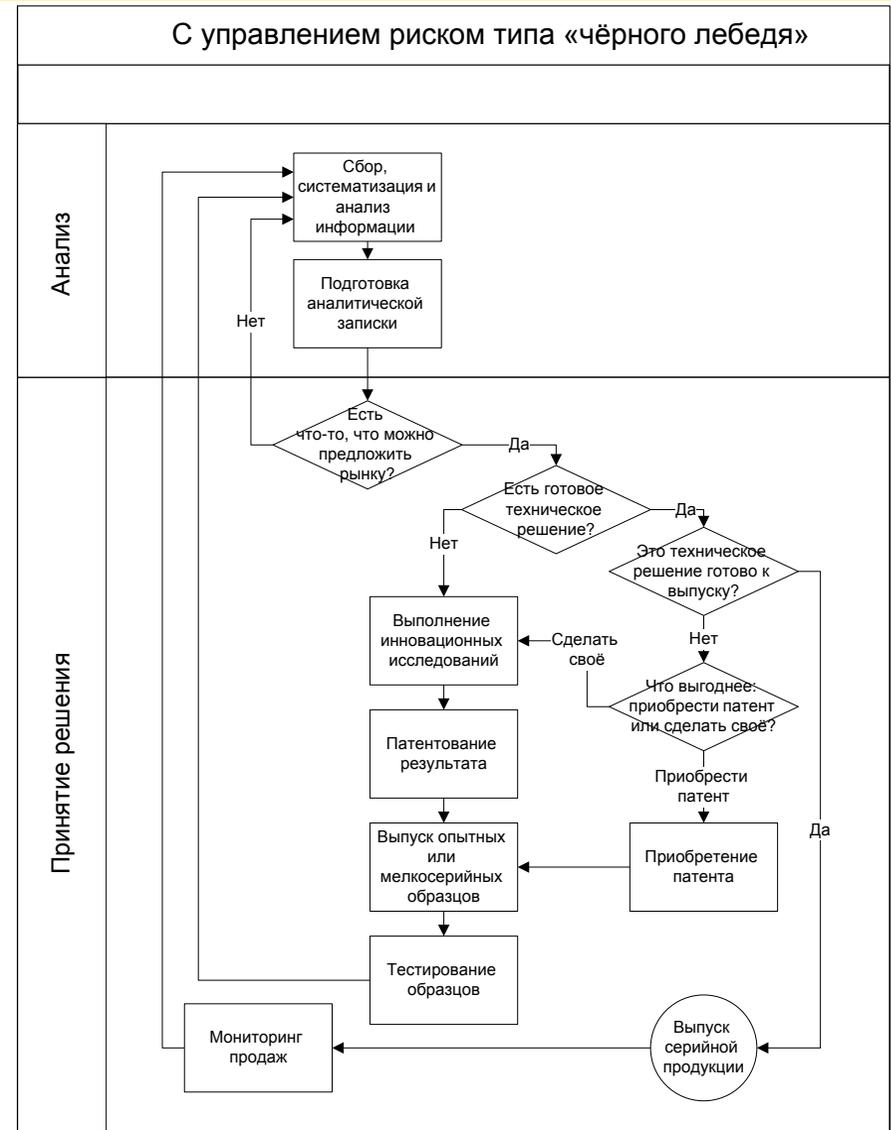
«Дорожная карта» достижения поставленной цели предполагает:

- 1) создание особой организации производственного процесса;
- 2) разработку методики оценки его эффективности с учётом мероприятий по управлению рисками типа «чёрного лебедя»;
- 3) внедрение процедуры динамического управления производством, которая включает в себя:
 - организацию динамического планирования;
 - соответствующую подготовку персонала;
 - построение необходимой структуры управления и функционирования;
 - формирование адекватной инфраструктуры предприятия.

Особенность решения задачи

- **Интегрировать** методику управления рисками типа «чёрного лебедя» **придётся в существующий** производственный процесс.
- Для этого **необходимо предложить** наиболее технологичный **способ адаптации** производственного процесса к новым требованиям.
- Наиболее **безболезненно** новую организацию производственного процесса, обеспечивающего минимизацию последствий риска типа «чёрного лебедя», можно реализовать **при подготовке и выпуске новой** или модернизированной **продукции**.
- В пользу данного выбора говорит и то, что в этом случае **вероятность реализации** рисков типа «чёрного лебедя» **будет наиболее высокой**.

Процесс анализа и принятия решения



Дополнительные рекомендации

1. При выпуске новой продукции, если возникла необходимость приобретения основных средств, следует ориентироваться на **приобретение не узкоспециализированного оборудования, а станков с числовым программным управлением**, позволяющим быстро перенастраивать режим его работы на выпуск новой продукции.
2. **Технология выпуска различных вариантов** новой продукции должна быть **максимальным образом унифицирована**, чтобы переход от выпуска одной модели к выпуску другой был как можно менее трудоёмким и ресурсно-затратным .
3. **Выпускать** целесообразно **линейку моделей** с разными свойствами и с разным объёмом выпуска. Более востребованные модели выпускать в большем количестве, менее востребованные – в меньшем.

Выводы

1. Управление риском типа «чёрного лебедя» представляет собой особую организацию производственного процесса.
2. При организации производственного процесса необходимо следовать определённым принципам управления рисками типа «чёрного лебедя».
3. Наиболее безболезненно новую организацию производственного процесса, обеспечивающего минимизацию последствий риска типа «чёрного лебедя», можно реализовать при подготовке и выпуске новой или модернизированной продукции.

A faint, light gray world map is visible in the background of the slide, centered behind the text.

Информация, содержащаяся в этой презентации, является индикативной и не может быть использована без дополнительных консультаций с ЕУ. ЕУ не гарантирует, что информация в данной презентации является достаточной или даже приемлемой для использования какой-либо третьей стороной. Никто не может принимать каких-либо решений на основе этой презентации без предварительного согласования с ЕУ. Если кто-либо принял такое решение на основе информации, помещенной в этой презентации, то он сам отвечает за это решение. ЕУ отказывается от любой ответственности по отношению к третьим лицам в отношении таких решений и их последствий.