

МОДЕЛІ РИЗИК-МЕНЕДЖМЕНТУ В ЗАДАЧАХ СТРАТЕГІЧНОГО ПЛАНУВАННЯ РОЗВИТКОМ ПАЛИВНО-ЕНЕРГЕТИЧНОГО КОМПЛЕКСУ

В даний час розвиток паливно-енергетичного комплексу (ПЕК) продовжує зазнавати радикальної трансформації від централізованого державного планування до нової парадигми багатостороннього процесу обґрунтування рішень. За даних умов в процес стратегічного планування, аналізу і прийняття рішень виявляються залученими багато учасників (суб'єктів відносин) з різними інтересами. Наявність значної кількості груп суб'єктів відносин, кожен з яких приймає на себе частину ризику, певною мірою є фактором ризику, оскільки невиконання хоча б одним з них своїх зобов'язань може призвести до виникнення небажаних подій (наприклад, збитків (або втрат) внаслідок порушення надійного режиму систем ПЕК).

Різносторонність інтересів конкуруючих суб'єктів ринку обумовлена, перш за все, принципово новим механізмом встановлення відпускних цін та тарифів на електроенергію. Також проблема ризиків пов'язана із подальшою зміною організаційної структури галузі й суб'єктів її відносин. Таким чином, стратегічне планування розвитку ПЕК безпосередньо пов'язана з проблемою використання всіх можливостей сучасного ризик-менеджменту. Сьогодні чинниками, які сприяють підвищенню ролі ризик-менеджменту, є глобалізація фінансових та енергетичних ринків, зростання міжнародної конкуренції, збільшення об'ємів ринків і зростання інтенсивності дефолтів.

Наукове обґрунтування пріоритетів стратегічного планування розвитком ПЕК в умовах ризику неможливе без застосування відповідних інструментів аналізу – моделей підтримки управлінських рішень, теоретико-методичною основою побудови яких є теорія ризику та теорія прийняття рішень.

В сучасній практиці розроблено досить багато різноманітних типів моделей, які використовуються в ризик-менеджменті. Беручи до уваги критерії і ціль, яким відповідає дана модель, можна виділити моделі, які описують дане явище, та можуть бути використані для підтримки прийняття рішень. Крізь призму підтримки прийняття рішень в енергетиці доцільно розглянути два види моделей – нормативні і дескриптивні моделі рішень.

Нормативна модель рішення призначена для пошуку бажаного стану об'єкта чи системи. Напрямок, який займається розробкою і використанням нормативних моделей, називається формалізованою теорією прийняття рішень або теорією вибору. Його суть – концентрація зусиль на процедурі вибору рішення, пошуку оптимального рішення, тобто найкращого із можливих за певних початкових умов. Цей напрям широко використовує методи та принципи математики, логіки і статистики.

В енергетичній практиці нормативний підхід застосовується з обмеженнями, оскільки реальні процеси прийняття рішень часто більше диференційовані і складні, ніж це передбачено концепцією побудови закритих нормативних моделей. Довільне тлумачення основних принципів і відношень між змінними призводить до створення моделей настільки далеких від реальності, що їх використання в практиці управління є неможливим або ускладненим високим ступенем невпевненості в очікуваних результатах. Тому розглянуті моделі не надають реальної допомоги при прийнятті управлінських рішень, а область застосування нормативного підходу обмежена групою проблем, які добре або частково структуровані.

Дескриптивну (описову) модель призначено для опису спостережуваних факторів або прогнозу поведінки об'єктів на відміну від нормативної моделі, яка передбачає знаходження бажаного (наприклад, оптимального) стану об'єкта. Побудова дескриптивних моделей рішення пов'язана з тим, що на хід процесу прийняття рішень впливають ряд обставин, зокрема: тип проблеми і риси ситуації рішення; складність та часовий горизонт проблеми; ступінь невпевненості відносно варіантів і результатів рішень; вплив часу на проблемну ситуацію; характеристики оточення вибору рішення в обсязі розділення компетенцій, мотиваційні аспекти, спосіб функціонування інформаційної системи, моделювання процесів управління; характеристика особи, яка приймає рішення (ОПР) - кваліфікація, знання, досвід, здатність розуміння й аналізу проблемних ситуацій, персональні особливості або посада, яку займає особа в організації. Дії ОПР при створенні дескриптивних моделей можна охарактеризувати такими ознаками: вибір ідеальної цілі; визначення норм, законів і принципів наближення; перегляд кількості альтернатив і прийняття рішення, не обов'язково оптимального, але такого, яке задовольняє вимоги і цілі. Але економічна практика показує, що необхідно розглядати процеси рішення і в масштабах всієї організації (колективне прийняття рішень), що відповідає системному підходу, тобто розглядати всю енергетичну систему як множину пов'язаних проблем для прийняття рішень.

Таким чином, застосовуючи теорію та моделі ризик-менеджменту в управлінні енергетичними системами можна знизити ризиковість прийняття рішень, вибрати з визначених альтернатив правильну, стратегічно спланувати подальшу діяльність та розвиток ПЕК.