

3.7.3. Управление рисками

Руководство Группы НМТП реализует целенаправленную политику минимизации влияния внешних факторов, способных оказать негативное воздействие на деятельность компаний Группы НМТП.

Принципы и подходы к построению и функционированию системы управления рисками Группы НМТП позволяют выявлять риски, оценивать их существенность, реагировать на них для снижения вероятности наступления нежелательных последствий. Параметры проводимых мероприятий зависят от особенностей создавшейся ситуации в каждом конкретном случае.

В Группе внутренний контроль и управление рисками интегрированы в многоуровневую систему управления и являются ее неотъемлемой частью, в связи с чем развитие и совершенствование вышеуказанных компонентов является одной из важнейших задач корпоративного управления.

В ПАО «НМТП» создан и функционирует специализированный орган системы управления рисками и внутреннего контроля — Служба внутреннего контроля и управления рисками (далее — Служба).

Основными функциями Службы в области управления рисками являются:

- анализ и оценка заключаемых договоров на предмет наличия рисков финансово-хозяйственной деятельности;
- экспертиза управленческой отчетности Компании;
- проведение плановых и внеплановых проверок с целью выявления рисков, присущих финансово-хозяйственной деятельности Компании;
- разработка, актуализация локальных нормативных документов в области управления рисками;
- общая координация процессов управления рисками;
- анализ портфеля рисков и выработки предложений по стратегии реагирования в отношении управления соответствующими рисками;
- подготовка отчетности по управлению рисками.

В Группе используются следующие методы управления рисками:

- воздействие на риск — основной и приоритетный вариант управления рисками. Включает комплекс превентивных мероприятий, направленных на удержание риска на существующем уровне с одновременным активным воздействием на него со стороны Компании для снижения вероятности наступления рисков события и (или) снижения потенциального ущерба до уровня риск-аппетита;
- устранение источника риска — вариант управления риском, подразумевающий частичный отказ от бизнес-процесса либо модификацию принимаемого решения в той его области, которая содержит наибольший риск. При этом такая модификация должна быть экономически обоснованной;
- разделение риска — передача всего риска либо его части иным лицам посредством инструментов страхования, хеджирования, финансовых гарантий и т. д. Данный вариант применяется в том случае, когда воздействие на риск экономически неэффективно, а принятие невозможно из-за недопустимо высокого уровня риска;
- изменение последствий — комплекс мероприятий, направленный на нивелирование негативных последствий, возникновение которых обусловлено наступлением риска. При этом затраты на изменение последствий должны быть адекватными и сопоставимыми с выгодами, извлекаемыми от использования данного варианта;
- принятие риска — отказ от любого воздействия на риск ввиду его незначительности, то есть нахождения в пределах риск-аппетита, либо в случае, когда затраты по управлению риском экономически не обоснованы. Принятие риска может происходить лишь в том случае, когда применение иных вариантов управления, кроме избежания риска, не эффективно. В результате принятия риска Компания может формировать различные финансовые резервы, фонды. Принятие риска одновременно означает использование такого варианта управления, как «изменение последствий» к модифицируемой части риска;
- избежание риска — подразумевает отказ от совершения тех или иных действий (не начинать, не продолжать или не возобновлять деятельность), несущих в себе высокий риск. Применение данного варианта должно носить исключительный характер и применяться лишь в том случае, когда совокупная стоимость воздействия на риск экономически не выгодна, либо такое воздействие невозможно, равно как и невозможно разделение риска.

НАИБОЛЕЕ СУЩЕСТВЕННЫЕ РИСКИ, ПРИСУЩИЕ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ГРУППЫ

Описание риска	Мероприятия по управлению
Риск роста процентной ставки по кредитному договору (рост ставки LIBOR)	Контроль движения денежных средств для обеспечения достаточного запаса ликвидности. Централизованное размещение депозитов Группы НМТП для достижения наибольшего эффекта от процентных ставок. Постоянный мониторинг ставки LIBOR
Риск изменения курса валют	Рассмотрение возможности заключения кредитного договора в рублях. Размещение депозитов в валюте
Риск потери объемов в случае введения санкций в отношении клиентов	Анализ загрузки и использования производственных мощностей для оценки высвобождающихся мощностей в случае введения санкций и остановки грузопотока. Определение альтернативной грузовой базы в случае остановки грузопотока. Ведение переговоров с клиентами на оперативное замещение выпадающих объемов
Риск снижения грузопотока Группы НМТП в результате строительства дополнительных портовых мощностей в Азово-Черноморском бассейне	Взаимодействие с клиентами: подписание стратегических соглашений, меморандумов с целью сохранения объемов, предложение выгодных условий сотрудничества, гибкое ценообразование, предложение лучшего сервиса. Своевременная реализация инвестиционных проектов
Операционные риски, связанные с поломкой/повреждением перегрузочной техники и гидротехнических сооружений	Для эксплуатации оборудования привлекается высококвалифицированный персонал, перегрузочное оборудование своевременно обслуживается и обновляется. Проведение плановых ремонтов и очередных освидетельствований гидротехнических сооружений
Публикация негативной, искаженной информации, способной нанести ущерб деловой репутации Группы НМТП	Регулярный мониторинг упоминаний Группы НМТП в СМИ и сети Интернет. Активное взаимодействие с журналистами. Соблюдение регламентов согласования и раскрытия информации на всех уровнях

Ключевые мероприятия по управлению рисками и развитию системы в 2018 году

Распространение действия утвержденной Методики по управлению рисками ПАО «НМТП» от 10 июня 2015 г. на дочерние и зависимые общества для унификации процесса управления рисками в Группе НМТП.

Подготовка корпоративных карт рисков.

Страхование имущества Компании и ответственности перед третьими лицами.

Анализ действующих локальных нормативных актов на предмет их эффективности, соответствия поставленным целям и бизнес-среде Компании.

3.7.3.1. Страновые и региональные риски

Перевод значительных объемов российской нефти с западного и южного на восточное направление.

Снижение спроса на некоторые традиционные внешнеторговые грузопотоки ввиду перепроизводства и затоваривания мировых рынков некоторыми видами товаров/грузов (нефть, ЖРС, уголь) из-за открытия новых месторождений, снижения себестоимости производства за счет применения новых технологий.

3.7.3.2. Политические риски

Эскалация напряженности в Баб-эль-Мандебском и Аденском проливах в связи с военными действиями в Йемене.

Нарушение платежеспособности стран — участниц локальных конфликтов (Ближний Восток).

Введение и (или) расширение секторальных и экономических санкций в отношении России со стороны США, стран ЕС и ряда других стран.

Нестабильная военно-политическая ситуация в странах бывшего Советского Союза и Балканского полуострова, возобновление активных действий в «замороженных конфликтах» в зоне интересов Российской Федерации (Украина, Армения, Азербайджан, Грузия, Сербия, Молдавия).