

# 电网企业关键风控预警指标设计

刘 薇,牟天军

(国网重庆市电力公司,重庆 400014)

**摘要:**为强化风险管控、提升风险管控精细度及风险管控效率,本文分建立风控信息库、识别关键风控因素、设计建立风险关键预警指标、明确重大风险事项、分析研判发布风险预警提示五个步骤探索设计 16 项电网企业重大风险预警指标,进一步提升风险管控效率与效果。

**关键词:**电网企业;关键风控预警指标设计

[DOI]10.12231/j.issn.1000-8772.2020.27.197

## 1 实施背景

### 1.1 强化风险管控的需要

国网重庆市电力公司近年来在各项监督检查中发现风险防控仍存在一些薄弱环节,主要表现在风险评估主观化、应对措施标准化及措施落地程序化。为从源头上改进风险评估方法和标准,推动风险评估可量化,拓展各个专业管理工具在风险评估、分析和预判中的应用范围,进一步健全风险闭环管理机制,需要探索设计一套契合自身实际情况的风险预警指标。

### 1.2 提升风险管控精细度的需要

国网重庆市电力公司近年来已形成一套有效的风险信息库及风险管控体系,但在一些方面仍存在短板:一是风险框架的设计与现行的部门职能设置存在差异;二是部分专业风险成因分析不够准确全面;三是部分风险存在交叉、重复等现象。为进一步优化风险管控体系,满足风险管控精细化要求,需对现有风险框架进行优化细化,建立提炼风险预警指标形成预警体系。

### 1.3 提升风险管控效率的需要

现行风险管控涉及战略风险、项目投资风险、财务管理风险、工程管理风险、电网安全生产风险等 13 个一级风险和 202 个末级风险,涉及专业广、末级风险数量大。在其中选取重大风险关键预警指标,建立风险预警指标体系,对重大风险事件预警指标进行监控,以达到风险预警提示的目的,有助于简化风险管控工作步骤,进一步提升风险管控效率。

## 2 电网企业关键风控预警指标设计

关键风控指标,代表某一风险事件变化情况可定期监控的统计指标。关键风控指标设计则是依据公司经营情况与外部因素的变化,识别可能影响风险发生频率和影响程度的风险因素,选取关键风险指标进行统计分析,预判风险发生概率及分布情况。国网重庆市电力公司本次将分以下五步探索开展关键风控指标的设计。

### 2.1 建立风控信息库

组织相关专业部门按照全面性、重要性和适用性的原则,从风险视角出发对国网公司风险框架进行系统性梳理并建立风控信息库。根据部门职责、岗位职责梳理可能存在的三级风险,按照风险名称分类归纳到二级风险中;通过分析面临的宏观政策、经济形势等外部因素,从计划、执行、检查和行动四个维度分析内部因素,识别风险成因,并完善相关风险描述、风险成因等信息。

### 2.2 识别关键风控因素

组织各风险主责部门在风控信息库基础上梳理近年来专项风险管理报告、内外部监督检查发现的问题、发生的风险事件及分析报告、风险调查问卷等风险信息,汇总分析风险成因,结合发展目标、管理制度、信息系统、岗位流程等内部因素和经济形势、监管要求、安全稳定、自然灾害等外部因素,在围绕公司发展目标的原则下,识别影响风险发生可能性的关键因素。

### 2.3 设计建立风险关键预警指标

针对识别出的关键风控因素,组织对相关部门通过实地访谈、调查问卷等方式,借鉴专业风险分析预警指标,从管理层面和业务层面两个维度,按照相关性、可量化、预测性原则选取风险分析指标或事项,确定关键风险预警指标名称、指标内容及描述、计算公式或统计方法、指标

来源、指标阈值、预警频率等内容,同时根据指标特性合理设置重复指标及互斥指标,设计并建立风险关键预警指标。

### 2.4 明确重大风险事项

选取公司全面风险管理报告中评估出的重大风险作为公司重大风险事项,包含自然灾害风险、人身安全风险、深化改革风险、电价政策风险、工程质量风险、公共关系风险、涉密风险、电费回收风险、物资供应风险、信访维稳风险 10 项风险。通过对重大风险逐一分解,分析风险成因,识别风险关键影响因素,结合风控信息库,选取关键预警指标,共分解 20 个末级风险,识别并选取 27 个关键预警指标。

组织相关部门运用调查问卷等方法,对选取的关键预警指标从相关性、来源可靠性、可量化性、时效性四个方面出发,进行适用性分析及综合评估。最终在 27 个指标中挑选出 16 个作为重大风险领域风险预警指标。具体指标如下:人身安全风险事件发生情况、人身安全事故赔偿金额、质量监督申报率、工程质量风险事件发生情况、工程完成率、质保金不合规支付比例、涉密人员保证书签订率、内外网串联事件、电费回收水平、仓储物流基础管理指数、物资合同履约完成率、稳定风险因素排查不到位信访次数、发生信访报送延误的次数、发生缠访闹访的信访次数、发生特重大影响突发事件次数。

### 2.5 分析研判发布风险预警提示

各业务部门根据风险预警指标频率,收集汇总测试区间内的预警指标数据。根据获取的指标数据,运用数理统计、风险值评估测算、横向比对应方法,充分发挥主观能动性,借鉴吸收内外部单位的各项数据,根据指标预定阈值并结合内外部环境,预判风险发生概率及分布情况,形成重大风险分析结论,并对风险预警值较高的所属单位发布风险预警提示函。

## 3 实施效果

### 3.1 风险管控体系进一步完善

重大风险关键预警指标的设计,是基于各项风险影响因素相关数据的可获取性,从风控角度对重大风险分布特点开展探索研究,有助于揭示风险事件的根本动因,为各专业提供了一种风险量化评估方法参考,风险管控体系进一步完善。

### 3.2 风险管控效果进一步增强

根据风险预警提示函要求,被预警单位进一步细化防控措施、加强防控力度,将风险防控工作布置情况形成书面文件上报并督导落实,动态监控风险发生情况。预警单位未发生重大公共关系及信访维稳风险事件,风险预警达到预期目标,风险管控效果显著提升。

### 3.3 风险监管效率进一步提升

重大风险关键预警指标的设计能够为公司决策层和管理层及时提供相关、有效和前瞻信息,预测未来一段时间内会发生和转移的风险,从而实现减少损失、为战略目标识别机遇、降低资金成本,减少风险事件发生概率的目的,逐步推动风控工作由“全面”向“精准”转变。

## 参考文献

- [1]刘伟等.企业经营风险预警指标体系与预警系统模型设计[J].科技进步与对策,2005(07).
- [2]沈真真,等.风险导向的企业内部控制设计[J].中国注册会计师,2013(02).