

Merak Capital Planning

Достижение корпоративных целей и устойчивого роста за счет оптимизации и динамического планирования

ПРИМЕНЕНИЕ

- Оптимизация инвестиционного портфеля нефтегазодобывающей компании

ПРЕИМУЩЕСТВА

- Формирование оптимального портфеля и оценка альтернатив с использованием нескольких методов оптимизации
- Сопровождение гибкого и эффективного процесса бизнес-планирования
- Принятие критических инвестиционных решений на основе портфельного анализа
- Проектирование оптимальной бизнес-стратегии

ОСОБЕННОСТИ

- Строгие процедуры оптимизации, основанные на задаваемых бизнес-правилах и ограничениях
- Настройка целевых показателей портфеля
- Применение различных методов оптимизации
- Детерминистические и стохастические методы оценки портфеля
- Широкие средства визуализации для анализа результатов

Merak* Capital Planning – информационное решение для бизнес-планирования в нефтегазодобывающих компаниях, специализирующееся на задачах широкого спектра: от планирования ГТМ или программы бурения на месторождении до перспективного планирования активов Компании.

Merak Capital Planning позволяет определить, какие проекты наилучшим образом обеспечат оптимальное выполнение стратегических целей и различного рода ограничений и взаимосвязей, когда и в каком объеме указанные проекты должны быть реализованы для достижения наилучших корпоративных показателей эффективности.

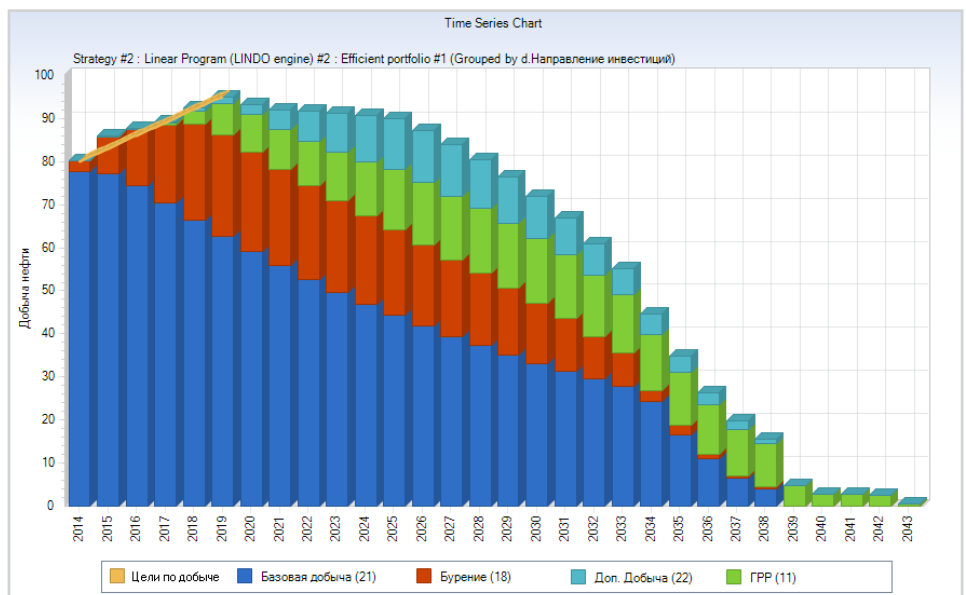
Графические возможности Merak Capital Planning дают возможность удобно и быстро визуализировать исходные данные, сравнивать результаты, подготавливать материалы для отчетности. Средства анализа включают в себя широкий выбор диаграмм, различную сортировку и группировку данных, интуитивно-понятный редактор пользовательских расчетов.

Гибкая настройка работы в Merak Capital Planning позволяет организовать процесс бизнес-планирования, наилучшим образом подходящий для Компании, сочетая накопленный корпоративный опыт и мировые стандарты процесса управления портфелем.

Оценка инвестиционных возможностей

Первый шаг к эффективному бизнес-планированию состоит в проведении «инвентаризации» потенциальных инвестиционных проектов. Примерами таких инвестиционных возможностей могут быть планируемые капитальные ремонты, бурение скважин, строительство инфраструктурных объектов, приобретение активов, участие в совместном предприятии или любые другие типы инвестиционных проектов, потенциально реализуемые Компанией. Чем больше заявлено инвестиционных возможностей, тем большую гибкость и вариативность можно получить при выборе стратегии: от консервативного пути минимизации рисков до сценария агрессивного роста.

В Merak Capital Planning данные об инвестиционных возможностях загружаются из Merak Peer или электронных таблиц Microsoft Excel произвольного формата, формируя в



Соответствие инвестиционного портфеля заданным ограничениям по добыче.

Merak Capital Planning

централизованной базе данных систематизированный, унифицированный каталог проектов-кандидатов.

Выбор инвестиционных проектов, которые будут включены в инвестиционный портфель, будет определяться множеством уникальных для конкретной задачи условий: цели по увеличению темпов добычи, наращивание ресурсно-сырьевой базы, финансовые и другие ресурсные ограничения, а также зависимости между проектами-кандидатами могут ограничить выбор инвестиционных возможностей.

Merak Capital Planning поможет задать подобные сложные бизнес-ограничения и цели и расставить для них приоритеты, указать различные взаимосвязи между проектами-кандидатами, указать

или создать новые критерии оптимальности портфеля, формируя таким образом необходимую портфельную стратегию.

Формирование оптимального портфеля

В силу специфики нефтегазодобывающей отрасли в корпоративном инвестиционном планировании необходимо использование методов оптимизации при формировании инвестиционного портфеля, наилучшим образом соответствующему многокритериальным целям и ограничениям.

В Merak Capital Planning реализовано несколько алгоритмов формирования портфеля: генерация случайных портфелей, ранжирование, метод линейной оптимизации и генетический алгоритм. Совместное использование этих методов позволяют оценить возможный диапазон интересующих параметров до формулировки ограничений, отобрать проекты на основании выполнимости поставленных ограничений, осуществить поиск максимума (или минимума) целевого параметра в области возможных решений, оценить чувствительность целевых показателей портфеля к заданным ограничениям, а также сформировать кривую предельной эффективности, по которой можно определять максимальную доходность портфеля для заданного допустимого уровня риска.

Принятие решений в условиях неопределенностей

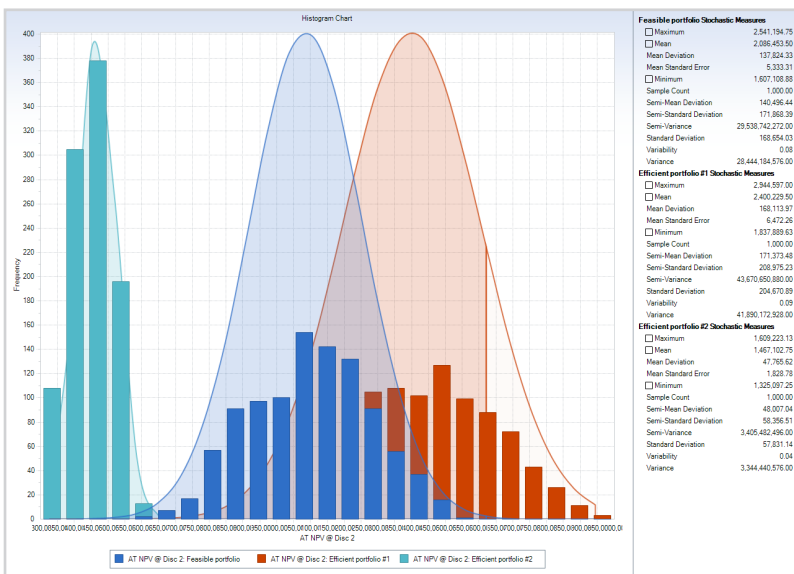
Портфельный анализ не ограничивается нахождением единственного «оптимального» решения, не подлежащего изменению. В условиях технологических макро- и микроэкономических неопределенностей необходимо рассматривать ряд наиболее привлекательных портфельных альтернатив, в рамках допустимого уровня риска сравнить несколько портфельных стратегий.

Merak Capital Planning представляет собой единую информационную среду для портфельного анализа, позволяющую проводить оценку и пересмотр инвестиционного портфеля по мере изменения операционных, технических или экономических предпосылок, оценивать запас прочности портфелей к установленным ограничениям, проводить анализ чувствительности для всего портфеля проектов к ценам или к участию в отдельных проектах, определять потенциальную доходность портфеля при различном уровне риска.

За более подробной информацией обратитесь в местное представительство компании «Шлюмберге» или пришлите запрос на нашу электронную почту sis-qa-ru@slb.com



Сравнение и редактирование альтернативных портфелей на план-графике.



Использование статистического функционала для анализа портфелей.