

Миколаїв: НУК, 2014. – 356с. – с. 203–205. **10.** Коуллопулос Т. М. Управление знаниями. / Т. М. Коуллопулос. – М. : Эксмо, 2008. – 224 с.

Bibliography (transliterated): **1.** Lister, T. *Valsiruya s medvedyami. Upravlenie riskami v proektah po razrabotke programmnogo obespecheniya.* Moscow: Kompaniya p.m. Office, 2005. Print. **2.** Rasmusson, Dzh. *Gibkoe upravlenie IT-proektami. Rukovodstvo dlya nastoyaschih samurayev. Kak Mastera Agile delayut vyidayushee.* Saint Petersburg: Piter, 2012. Print. **3.** Pesotskaya, E.Yu. "Upravlenie riskami pri vnedrenii IT-proektov. Kompyuternoe modelirovanie v nauke i tehnike." Web. 23 November 2014 <<http://econf.rae.ru/article/3910>>. **4.** Repin, V. V., and V. G. Eliferov. *Protsessnyy podhod k upravleniyu. Modelirovanie biznes-protsessov.* Moscow: RIA «Standarty i kachestvo», 2004. Print. **5.** Onischenko, I. I. "Tendentsiyi rozvitku upravlinnya rizikami proektiv IT-galuzi." *Tezi dopovIdey 11 mizhnarodnoyi konferentsiyi "Upravlinnya proektami u rozvitku suspilstva". Tema: Rozvitok kompetentnosti organizatsiyi v upravlinni proektami, programami ta portfelyami proektiv.* Kiev: KNUBA, 2014. Print. **6.** Tovb, A. S., and Tsipes G. L. *Upravlenie proektami: standarty, metody, opyt.* Moscow: ZAO „Ollmp-Biznes”, 2005. Print. **7.** Onischenko, I. I. "Klasifikatsiya rizikiv IT-proektiv – metodiv". *Upravlinnya proektami: stan ta perspektivi: Materiali IX Mizhnarodnoyi naukovopraktichnoyi konferentsiyi.* Nikolaev: NUK, 2013. 224–227. Print. **8.** Onischenko, I. I. "Analiz rizikiv v protsesi upravlinnya IT-proektami". *Visnyk NTU "HPI". Ser.: Systemnyj analiz, upravlinnja ta informacijni tehnologii.* No. 3 (1046). Kharkiv: NTU "HPI", 2014. Print. **9.** Onischenko, I. I. "Stvorennaya bazi danih rizikiv proektiv kompaniyi. Upravlinnya proektami: stan ta perspektivi. Materiali 10 Mizhnarodnoyi naukovopraktichnoyi konferentsiyi." Nikolaev: NUK, 2014. Print. **10.** Kouloupolous, T. M. *Upravlenie znaniyami.* Moscow: Eksmo, 2008. Print.

Надійшла (received) 11.11.2014

УДК 338.244

Е. А. ЦЕЛОВАЛЬНИКОВА, аспирант МГУ, Одесса

СОВРЕМЕННЫЕ ПРОБЛЕМЫ И ЗАДАЧИ В УПРАВЛЕНИИ ПОРТФЕЛЯМИ ПРОЕКТОВ

В статье освещены основные задачи и современные проблемы в управлении портфелями проектов, так как процедура управления портфелем проектов существенно отличается от управления одним проектом, она, по сути, является процедурой более высокого уровня и имеет иные цели и средства их достижения. Целью настоящего исследования является разработка метода формирования сбалансированного портфеля проектно-ориентированной организации на основе анализа макроэкономических циклов и прогноза изменения состояния внешней среды. Предложен метод формирования сбалансированного портфеля в проектно-ориентированной организации с учетом анализа фаз экономических циклов.

Ключевые слова: портфель проектов, мониторинг процессов, инновационная деятельность.

Введение. Сегодня для устойчивого развития и получения конкурентных преимуществ организациям уже недостаточно успешной реализации отдельных проектов. Для достижения максимального эффекта от

использования методологии проектного менеджмента в организации необходимо комплексное применение проектных подходов к управлению на всех уровнях руководства и принятия решений в компании. Важнейшим связующим звеном между стратегическим уровнем управления и уровнем управления отдельными проектами являются портфели проектов и программ [1].

Управление проектами по отдельности или управление портфелем как рядом отдельных проектов порождает целый ряд проблем: могут дублироваться работы, возникать несогласованные (а иногда и противоположные) цели по различным компонентам, неэффективно использоваться дефицитные ресурсы, неверно оцениваться и учитываться прибыль. В итоге общий показатель риска портфеля увеличивается, а рентабельность инвестиций и общая результативность — снижается.

Анализ основных достижений и литературы. Портфельное управление проектно-ориентированной организацией позволяет решать следующие задачи:

- гарантированно реализовывать стратегию организации;
- согласовывать планируемые инвестиции и производимые расходы со стратегическими целями и задачами;
- принимать стратегически обоснованные управленческие решения;
- устанавливать приоритеты для выполняемых компонентов;
- повышать обоснованность распределения ресурсов и эффективность их использования при реализации проектов/программ;
- своевременно останавливать выполнение работ по компонентам, не соответствующим стратегии организации.

В последние годы проблемам портфельного управления уделяется большое внимание. Исследования многих отечественных и зарубежных специалистов [2–6] посвящены разработке моделей и методов формирования эффективного портфеля проектов, механизмов ранжирования и балансировки проектов в портфеле, оптимизации работы офиса управления портфелем проектов.

Безусловный интерес представляет исследования [7], в которых автор выделяет три группы портфелей проектов:

- операционный портфель проектов, отличительными особенностями которого является известность технологических принципов и ресурсов, их относительно низкая стоимость и большое число в портфеле;
- инвестиционный портфель, который характеризуется дополнительными рисками на эксплуатационной стадии окупаемости проекта;
- инновационный портфель проектов, основными чертами которого можно считать относительно большие значения рисков недостижения запланированных результатов проекта.

В дальнейшем автором предложен композиционно-модульный подход к методологии формирования и управления портфелями проектов, на основе которого разработаны методы управления портфелями разных типов.

В реальности, если говорить о портфеле проектно-ориентированной организации, то он должен включать в себя одновременно операционные, инвестиционные и инновационные проекты. Под операционными проектами можно понимать основное производство, направленное на выпуск продукции компании, под инвестиционными – проекты, целью которых является расширение объемов производства (строительство новых предприятий, приобретение оборудования, технологий и пр.), а под инновационными – научно-исследовательские проекты, нацеленные на выпуск новых видов продукции. При этом баланс между проектами разных типов должен учитывать стратегические цели организации, с одной стороны, и постоянное изменение состояния среды – с другой. Именно фактор, учитывающий текущее состояние и прогноз изменения внешней среды организации, не нашел своего отражения в разработанных механизмах, что, по нашему мнению, влечет за собой значительные погрешности в получаемых результатах.

Целью настоящего исследования является разработка метода формирования сбалансированного портфеля проектно-ориентированной организации на основе анализа макроэкономических циклов и прогноза изменения состояния внешней среды.

Изложение основного материала. В действительности любая организация, как и экономика в целом развивается не по прямой линии (тренду), характеризующей экономический рост, а через постоянные отклонения от тренда, через спады и подъемы, циклически.

В экономическом цикле выделяют четыре фазы:

- I фаза – бум (boom), при котором экономика достигает максимальной активности. Это период сверхзанятости (экономика находится выше уровня потенциального объема производства, выше тренда) и инфляции;

- II фаза – спад (recession или slump). Экономика постепенно возвращается к уровню тренда, уровень деловой активности сокращается, фактический ВВП доходит до своего потенциального уровня, а затем начинает падать ниже тренда, что приводит экономику к следующей фазе – кризису;

- III фаза – кризис (crisis) или стагнация (stagnation). Экономика находится в состоянии рецессионного разрыва, поскольку фактический ВВП меньше потенциального. Это период недоиспользования экономических ресурсов, т.е. высокой безработицы;

- IV фаза – оживление или подъем. Экономика постепенно начинает выходить из кризиса, фактический ВВП приближается к своему

потенциальному уровню, а затем превосходит его, пока не достигнет своего максимума, что вновь приведет к фазе бума.

В современной экономике продолжительность фаз цикла и амплитуда колебаний могут быть самыми различными. Это зависит от состояния мировой экономики, степени государственного вмешательства, характера регулирования экономики, доли и уровня развития сферы услуг (непроизводственного сектора), условий развития и использования научно-технической революции.

С целью определения основных параметров различных циклов и на их основе прогнозирования развития организации нами предлагается проведение статистического анализа результатов деятельности компании. На рис. 1 представлен суммарный объем переработки контейнеров в TEU компанией СМА в 2010 – 2013 годах.

Обработка статистических данных проводится путем разложение сигнала в ряд Фурье [8].

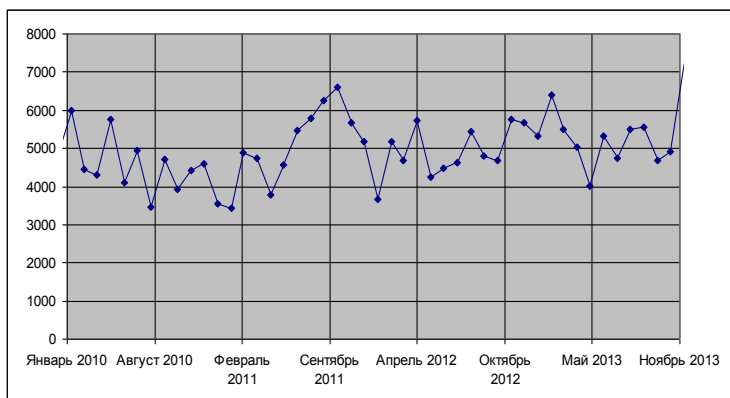


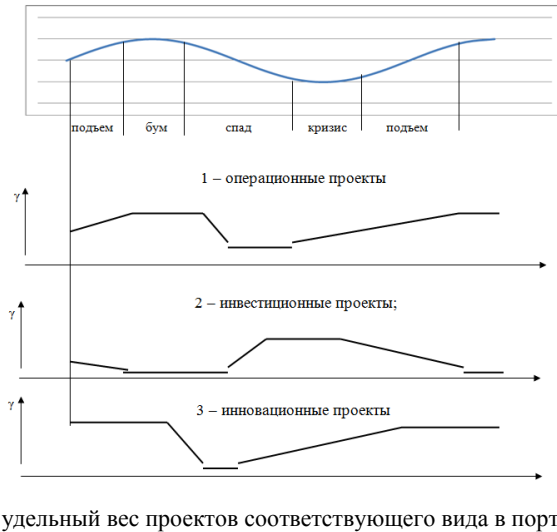
Рис. 1 – Результаты деятельности компании СМА в 2010 – 2013 годах.

Таким образом, сложную функцию можно представить в виде суммы гармоник, при этом период каждой гармоники соответствует периоду экономического цикла, а амплитуда определяет степень влияния данного цикла на результаты деятельности организации. Данный анализ позволяет значительно повысить точность прогноза деятельности компании в перспективном периоде и определить, в какой фазе цикла она сейчас находится.

Полученная информация необходима для формирования сбалансированного портфеля проектов, поскольку в разных фазах цикла основное внимание следует уделять разным видам проектов.

На рис. 2 схематично представлены фазы циклов проектно-ориентированной организации и те виды проектов, планированию и

реализации которых следует уделять наибольшее внимание на данной фазе цикла.



γ – удельный вес проектов соответствующего вида в портфеле

Рис. 2. – Состав сбалансированного портфеля проектов организации на разных стадиях цикла

Вывод. В статье предложен метод формирования сбалансированного портфеля в проектно-ориентированной организации с учетом анализа фаз экономических циклов.

Список літератури: 1. Козлов А.С. Методология управления портфелями программ и проектов. – М., ФЛИНТА, 2011. – 194 с. 2. Кендалл Д.И. Современные методы управления портфелями проектов и офис управления проектами. / пер. с англ. / Д.И. Кендалл, С.К. Роллинз. – М.: ПМ Софт, 2004. – 576 с. 3. Матвеев А.А. Модели и методы оперативного управления портфелем проектов / А.А. Матвеев, Д.А. Новиков, К.А. Сухачев // Сб. трудов международной конференции «Современные сложные системы управления». – Тула, 2005. – С. 128 – 135. 4. Морозов В.В. Управління портфелем проектів на основі процесного підходу до прийняття стратегічних рішень. / В.В. Морозов, С.І. Рудницький // Восточно-Европейский журнал передовых технологий. – 2012. – № 1/12. – С. 39–41. 5. Петренко Ю.А. Модели и методы выбора программы в проектно ориентированной организации. / Ю.А. Петренко // Прикладные информационные технологии. – 2011. – №2/10 (50). – с. 30 – 36. 6. Muller R., Martinsuo M. Project portfolio control and portfolio management performance in different contexts. // Project management journal. – 2008. V.39. – pp.28–42. 7. Ванюшкин А.С. Композиционно-модульный подход формирования моделей управления портфелями проектов. / А.С. Ванюшкин. // Управление развитием сложных систем, КНУБА, Киев. – 2012. – №11. – с.18–28. 8. Никольский С. М. Курс математического анализа. – М.: Наука, 1983. – Т. 2. – 448 с.

Bibliography (transliterated): 1. Kozlov, A.S. *Metodologiya upravleniya portfelyami program i projektov*. Moscow: Flinta, 2011, Print. 2. Kendall, D.I. and S. K. Rollinz. *Sovremennyye metody*

upravleniya portfelyami proektov i ofis upravleniya proektami. Moscow: PM Soft, 2004. Print. **3**. Matveev, A.A., D.A. Novikov, K.A. Suhachev "Modeli i metody operativnogo upravleniya portfelem proektov ". *Sb. Trudov mezhdunarodnoy konferenzii "Sovremennyye slozhnye sistemy upravleniya "*. – Tula, 2005. 128–135. Print. **4**. Morozov, V.V., and S.I. Rudnizkiy "Upravlinnya porfelem proektiv na osnovi prozesnogo pidhodu do pryjnyattyastrategichnyh rishenij." *Vostocho-Evropeiskiy journal peredovykh tehnologiy*. No. 1/12. 2012. 39–41. Print. **5**. Petrenko, U.A. "Modeli I metody vybora programy v proektno oriyentirovannoy organizazii." *Prokladnye informazionnye tehnologii*. No. 2/10 (50). 2011. 30 – 36. Print. **6**. Muller, R., and M. Martinsuo "Project portfolio control and portfolio management performance in different contexts." *Project management journal*. No.39. 2008. 28–42. Print. **7**. Vanushkin, A.S. "Kompozitsionno – modulniy podhod formirovaniya modelej upravleniya portfelyami proektov." *Upravlenie razvitiem slozhyh system*, No. 11. Kiev: KNUBA. 2012. 18-28. Print. **8**. Nikolskiy, S.M. *Kurs matematicheskogo analiza*. – Moscow: Nauka, Vol. 2. 1983. Print.

Поступила (received) 20.11.2014