**Климова Тетяна Володимирівна. Формування портфеля інвестиційних проектів на підприємстві в умовах відсутності зовнішнього інвестування у розвиток виробництва. : Дис... канд. наук: 05.13.22 – 2008**

|  |  |
| --- | --- |
| |  | | --- | | **Климова Т.В. Формування портфеля інвестиційних проектів на підприємстві в умовах відсутності зовнішнього інвестування у розвиток виробництва.** – Рукопис.  Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата технічних наук за спеціальністю 05.13.22 – управління проектами та програмами. – Національний транспортний університет, Київ, 2007.  В роботі запропоновано новий метод та моделі формування портфеля проектів на підприємстві в умовах відсутності зовнішнього інвестування у розвиток виробництва. Запропонований метод дозволяє формувати обґрунтований план проектної діяльності підприємства за рахунок спільного використання методів стратегічного планування, теорії гібридних автоматів та теорії портфельних інвестицій. Моделі формування портфеля проектів, що є основними науковими результатами роботи, дозволяють у комплексі врахувати параметри реалізації проектів і ресурсні можливості підприємства та скоротити число варіантів перебору за рахунок введення додаткових обмежень на використання ресурсів підприємства. Визначення потрібних ресурсів в процесі реалізації портфеля проектів пропонується здійснювати за допомогою методів та моделей теорії гібридних автоматів, що дозволяє моделювати складні процеси реалізації портфеля проектів на виробництві з урахуванням множини факторів ризику.  На основі запропонованих методу та моделей розроблено структуру та реалізовані в програмному вигляді елементи інтегрованої інформаційно-аналітичної комп’ютерної системи для підтримки рішень в процесі формування портфеля інвестиційних проектів, яка дозволяє проводити аналіз якісно та оперативно. | |
| |  | | --- | | У дисертації наведено теоретичне узагальнення й нове рішення актуальної науково-прикладної задачі розробки комплексу моделей, методів і інформаційних засобів формування портфеля інвестиційних проектів в умовах відсутності зовнішнього інвестування в розвиток виробництва. У роботі було вирішено наступні задачі:   1. Проаналізовано процес реалізації портфеля інвестиційних проектів розробки нової техніки на підприємствах України. Проаналізовано існуючі методи, моделі й інформаційні технології управління проектами й визначення стратегічних напрямків діяльності підприємства. Аналіз існуючих методів і моделей дозволив зробити виводи, що методи формування портфеля проектів засновані на аналізі параметрів проектів без урахування можливостей підприємства, взаємного впливу ризиків і доходностей проектів, не розглядається зміна параметрів ресурсного забезпечення для реалізації портфеля проектів у часі. Тому, існує необхідність розробки нових моделей і методів формування портфеля проектів з урахуванням поточного стану підприємства й стратегій його діяльності в майбутньому, а саме в умовах реалізації стратегії відсутності зовнішнього інвестування в розвиток виробництва. 2. Розроблено метод формування портфеля проектів, що на відміну від існуючих, дозволяє формувати обґрунтований план реалізації портфеля проектів в умовах відсутності зовнішнього інвестування в розвиток виробництва. Цей метод, що запропонований уперше, заснований на спільному застосуванні методів стратегічного планування, теорії гібридних автоматів і теорії портфельних інвестицій. У рамках цього методу одержали подальший розвиток методи стратегічного планування, управління проектами й формування портфелів проектів на виробничому підприємстві. 3. Запропоновано моделі формування портфеля проектів за рахунок введення додаткових обмежень на використання ресурсного забезпечення підприємства при реалізації множини проектів. У рамках цих моделей удосконалені моделі формування портфеля проектів за рахунок комплексного обліку параметрів реалізації проектів і ресурсних можливостей підприємства, що дозволяє скоротити число варіантів перебору в процесі попереднього відбору проектів. 4. Представлено моделі прогнозування стану підприємства при реалізації портфеля проектів, що дозволяє визначити наявність і обсяги ресурсного забезпечення для реалізації робіт із проектів з урахуванням виникнення ризиків несприятливих подій. У рамках даних моделей одержали подальший розвиток методи теорії гібридних автоматів за рахунок застосування їх при плануванні портфеля проектів. 5. Розроблено інтегрована інформаційно-аналітична СППР при формуванні портфеля проектів в умовах відсутності зовнішнього інвестування в розвиток виробництва, що дає можливість оперативно приймати обґрунтовані управлінські рішення.   6. Наукові положення застосовані на практиці. СППР реалізована у вигляді програмного продукту, за допомогою якого проаналізовані окремі процеси реалізації портфеля проектів на підприємствах – НВП «Хартрон-Експрес» і ЗАТ «Радій», про що свідчать відповідні акти впровадження. Застосування системи дозволило знизити ризик прийняття помилкових рішень, знизило витрати й скоротило строки на прийняття рішень. Розроблена система може бути використана керівниками підприємств різних рівнів управління, тому що дозволяє проводити моделювання реалізації портфелів проектів на виробничому підприємстві. | |