

مجموعه مدل ها و الگوهای مدیریت بدپروژه ها

به همراه محاسبه ریسک و بازده مورد انتظار سرمایه گذاری

نویسندگان:

«عضویت علمی دانشگاه آزاد اسلامی زاهدان»

زهره اربابی

«عضویت علمی دانشگاه آزاد اسلامی اصفهان»

سید کامران یحیانی

«عضویت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات تهران»

امیر عزیزی

|                     |                                                                                                                                                          |
|---------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| سرشناسه             | : اربابی، زهرا، ۱۳۴۴                                                                                                                                     |
| عنوان و نام پدیدآور | : مجموعه مدل‌ها و الگوهای مدیریت سبد پروژه‌ها به همراه محاسبه ریسک و بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاری / مولفین زهرا اربابی، سید کامران یگانگی، امیر عزیزی. |
| مشخصات نشر          | : زنجان: دانشگاه آزاد اسلامی، واحد زنجان، ۱۳۹۶.                                                                                                          |
| مشخصات ظاهری        | : ۱۱۲ ص: جدول، نمودار.                                                                                                                                   |
| شابک                | : 978-964-10-4649-3                                                                                                                                      |
| وضعیت فهرست نویسی   | : فیفا                                                                                                                                                   |
| موضوع               | : مدیریت طرح‌ها - امور مالی                                                                                                                              |
| موضوع               | : Project management-- Finance                                                                                                                           |
| موضوع               | : مدیریت طرح‌ها                                                                                                                                          |
| موضوع               | : Project management                                                                                                                                     |
| موضوع               | : مدیریت سبد سرمایه‌گذاری                                                                                                                                |
| موضوع               | : Portfolio management                                                                                                                                   |
| شناسه افزوده        | : یگانگی، سید کامران، ۱۳۵۵ -                                                                                                                             |
| شناسه افزوده        | : ریز، امیر، ۱۳۶۱.                                                                                                                                       |
| شناسه افزوده        | : دانشگاه آزاد اسلامی، واحد زنجان                                                                                                                        |
| شناسه افزوده        | : Islamic Azad University Zonjan branch                                                                                                                  |
| رده بندی کنگره      | : ۱۳۹۶ ۴۱۰۴۰۴ HD                                                                                                                                         |
| رده بندی دیویی      | : ۶۵۸/۴۰۴                                                                                                                                                |
| شماره کتابشناسی ملی | : ۴۶۹۲۴۹۱                                                                                                                                                |

عنوان کتاب: مجموعه مدل‌ها و الگوهای مدیریت سبد پروژه‌ها به همراه محاسبه ریسک و بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاری

ناشر : معاونت پژوهشی دانشگاه آزاد اسلامی، واحد زنجان

قیمت : ۵۰۰۰ تومان در تیراژ ۲۰۰۰ جلد

تألیف : دکتر زهرا اربابی، دکتر سید کامران یگانگی، دکتر امیر عزیزی.

صفحه‌آرا : محسن ساکتی

طراح جلد : روجا گرایلی

چاپ : اول ۱۳۹۶

انتشارات دانشگاه آزاد اسلامی واحد زنجان - معاونت پژوهشی

هرگونه چاپ یا تکثیر محتویات این اثر به موجب بند ۵ از ماده ۲ قانون حمایت از حقوق مولفان و مصنفان و هنرمندان، بدون اجازه کتبی مولف ممنوع می‌باشد. متخلفان تحت پیگرد قانونی قرار می‌گیرند.

## فهرست

| عنوان         | صفحه |
|---------------|------|
| پیشگفتار..... | ۱۱   |

## فصل اول

|                                                       |    |
|-------------------------------------------------------|----|
| مقدمه.....                                            | ۱۵ |
| اهداف.....                                            | ۱۶ |
| تعاریف و مفاهیم.....                                  | ۱۷ |
| پروژه.....                                            | ۱۷ |
| کنترل پروژه.....                                      | ۱۷ |
| مدیریت پروژه.....                                     | ۱۷ |
| مدیریت طرح.....                                       | ۱۸ |
| پورتفولیو.....                                        | ۱۹ |
| مدیریت پورتفولیو.....                                 | ۲۰ |
| مدیریت ریسک.....                                      | ۲۱ |
| هدف و مسئله از دیدگاه سازمانی.....                    | ۲۲ |
| دلایل ایجاد مدل و الگوهای مختلف مدیریت سبد پروژه..... | ۲۳ |
| ریسک در پورتفولیو.....                                | ۲۴ |
| بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاری.....                   | ۲۶ |

## فصل دوم

|                                                                   |    |
|-------------------------------------------------------------------|----|
| دلایل استفاده از مدیریت سبد پروژه.....                            | ۲۹ |
| ارتباط مدیریت پورتفولیو با طرح و پروژه‌ها.....                    | ۳۰ |
| طبقه‌بندی حوزه‌های تحقیقاتی پژوهشگران در مدیریت سبد پروژه‌ها..... | ۳۵ |

|    |                                                     |
|----|-----------------------------------------------------|
| ۳۸ | طبقه‌بندی روشهای پیشنهادی پژوهشگران در مدیریت سبدها |
| ۳۹ | ترکیب سبدها                                         |
| ۳۹ | انتخاب                                              |
| ۴۰ | بهره‌مندی                                           |
| ۴۰ | توازن                                               |

## فصل سوم

|    |                                                              |
|----|--------------------------------------------------------------|
| ۴۳ | چارچوب‌ها و مدل‌های بین‌المللی سبدها                         |
| ۴۳ | چارچوب موسسه مدیریت پروژه آمریکا (PMI)                       |
| ۴۸ | تعاملات فرآیند مدیریت پورتفولیو بر اساس PMI                  |
| ۵۰ | چارچوب Cooper و همکاران                                      |
| ۵۲ | چارچوب Archer & Ghannizadeh                                  |
| ۵۶ | چارچوب Entun & Graham                                        |
| ۵۸ | مدل استراتژی اسپرادلین و کورتیس                              |
| ۵۹ | مدل سبدهای استراتژیک                                         |
| ۶۱ | چارچوب‌های پیشنهادی انتخاب سبدها و مدیریت پورتفولیو در ایران |
| ۶۱ | چارچوب انتخاب سبدها و پژوهشی براساس استراتژیک سازمان         |
| ۶۲ | مدل فرآیندی نظام مدیریت پورتفولیو با کارت امتیاز متوازن      |
| ۶۴ | مدل فرآیندی نظام مدیریت پورتفولیوی پروژه نوری                |
| ۶۷ | چارچوب مدیریت راهبردی سبدها پروژه ارسنجانی                   |
| ۶۹ | چارچوب انتخاب سبدها پروژه ابونیا                             |

## فصل چهارم

|    |                      |
|----|----------------------|
| ۷۳ | ارزیابی عملکرد سبدها |
| ۷۴ | معیار شارپ           |

|     |                                                                       |
|-----|-----------------------------------------------------------------------|
| ۷۴  | ..... معیار ترینر                                                     |
| ۷۵  | ..... معیار جنسن                                                      |
| ۷۶  | ..... مشخصات مدل و چارچوب مناسب                                       |
| ۷۷  | ..... مقایسه چارچوب و مدل‌های پورتفولیوی بررسی شده                    |
| ۸۲  | ..... بررسی معیارهای عملکرد پورتفولیو                                 |
| ۸۲  | ..... نکات تدوین چارچوب پورتفولیو                                     |
| ۸۳  | ..... محاسبه بازده مورد انتظار سرمایه‌گذاری                           |
| ۸۴  | ..... محاسبه ریسک پورتفولیو                                           |
| ۸۵  | ..... روش‌های ارزیابی و رتبه‌بندی سبد پروژه‌های پژوهشی توسط پژوهشگران |
| ۹۹  | ..... خلاصه و نتیجه‌گیری                                              |
| ۱۰۳ | ..... منابع                                                           |
| ۱۰۹ | ..... نمایه                                                           |

## پیشگفتار

امروزه روند تحولات فناوری‌ها و تکثر عوامل موثر بر تحقق ایده‌ها و برنامه‌ها، دامنۀ عدم قطعیت‌هایی که دولت‌ها و سازمان‌ها در حیات خود با آن مواجه می‌شوند، بسیار وسیع است. این عدم قطعیت‌ها از منشأ متعدد داخلی یا خارجی ناشی می‌شوند و محدوده گسترده‌ای از مسایل فنی، قانونی، مدیریتی، انسانی و تجاری را در بر می‌گیرند.

بر این اساس اعتبار پیشرفت روزافزون ایران اسلامی که در منطقه‌ای با وجود ریسک‌های و مخاطرات ابرار گرفته است جز از رهگذر کشف استعدادهای سرشار معنوی و مادی، استفاده بهینه از ذخائر و منابع غنی و متنوع و زیرساخت‌های گسترده و مهم‌تر از همه، توسعه دانش نیروی انسانی متعهد و کارآمد محقق نمی‌شود.

در بسیاری از مواقع، طرح‌ها و پروژه‌هایی که از نظر مدیر پروژه تحت کنترل هستند، با ریسک به عنوان رخدادی شناخته شده برخورد می‌شوند که در اکثر مواقع پس از اثرگذاری این رخداد، تیم مدیریتی، کوشش می‌کنند که اثرات منفی آن را کنترل نمایند و برنامه اجرایی مناسب برای استفاده از اثرات مثبت آن را تدوین و اجرا نمایند که بنا بر آمار موجود، در اکثر پروژه‌ها الزاماً چنین رخدادهایی به خوبی مدیریت نمی‌شود که این امر موجب می‌گردد طرح‌ها و پروژه‌ها نتوانند به اهداف از پیش تعیین شده برسند و هزینه‌ای بسیاری از این رهگذر از منابع کشور و ملت بدون نتیجه

صرف شود و حتی در برخی موارد نیز، بروز مشکلات متعدد اجرایی و فنی سبب می‌گردد که اجرای پروژه برای مدت نامعلوم متوقف شود.

تجربه سی و اندی ساله اینجانب در مدیریت اجرایی در حوزه‌های مختلف نشان می‌دهد برای مواجهه اصولی و صحیح با چالش‌های صدر الذکر، وجود و بکارگیری یک الگوی مشخص مدیریتی مبتنی بر شناسایی و برنامه‌ریزی استراتژیک ریسک طرح‌ها و پروژه‌ها در کنار وجود مکانیزم‌هایی مبتنی بر پیش‌بینی و اجرای سناریوهای مقابله با ریسک‌ها و مخاطرات فنی، سازمانی، خارجی و ... نیاز است و این رویکردها سبب می‌شود تا فرایند تصمیم‌گیری و اولویت‌بندی گام‌های اجرایی از یک چهارچوب عقلایی پیروی کند که این امر موجب می‌شود که اهداف طرح‌ها و پروژه‌ها در محدوده تعین شده با کیفیت و صحت بالاتری محقق شود و منابع موجود با توجه به اولویت‌های اجرایی و فنی به نحو احسن تخصیص داده شوند و صحت عملکرد فرایند بر اساس یک چرخه و رویه منطقی نظیر PDCA ارزیابی شود.

مجموعه‌ای که توسط دوست و همکار عزیزم، استاد آقاي دکتر سید کامران یگانگی، سرکار خانم دکتر زهرا اربابی و دکتر امیر عزیززی تدوین شده است ضمن معرفی تفصیلی مکانیزم‌های مدیریت ریسک در طرح‌ها و پروژه‌ها با معرفی یک مدل مناسب برای تلفیق استراتژی با مدیریت ریسک، یک چهارچوب عملیاتی برای کمک به تصمیم‌سازی و تصمیم‌گیری‌های تیم مدیریت پروژه ایجاد نموده است که استفاده از آن می‌تواند برای تمامی مدیران و کارشناسان و تیم‌های برنامه‌ریزی، کنترل و مدیریت پروژه مفید فایده باشد.

امید است که با همه گیر شدن برنامه‌ریزی‌های جامع و آینده‌نگر، مسیر توسعه و پیشرفت ایران عزیزمان بیش از پیش برای آیندگان بویژه جوانان فرهیخته کشورمان هموار گردد.

اسداله درویش امیری

استاندار زنجان

www.ketab.ir