

ЗАТВЕРДЖУЮ

Проректор з наукової роботи

Анатолій Черноус

(підпис)

(ім'я, прізвище)

“ _____ ” _____ 2021р.

АНОТОВАНИЙ ЗВІТза виконану роботу за етапом № 1.1у рамках держбюджетної НДР
СумДУза 2 квартал 2021 р.Національна безпека через конвергенцію систем фінансового моніторингу та кібербезпеки:
інтелектуальне моделювання механізмів регулювання фінансового ринку
53.16.01-21/23.3Ф-02, ЯРОВЕНКО Г.М.

Назва етапу: Оцінювання зрілості діючої системи протидії фінансовим та кібер-шахрайствам та побудова фазових портретів їх «зрілості», «станів рівноваги» та «релаксаційних коливань втрати стійкості». Визначення ключових алгоритмів систем фінансового моніторингу та кібербезпеки.

Науковий результат: Розроблені фазові портрети «зрілості», «станів рівноваги» та «релаксаційних коливань втрати стійкості» на основі теорії біфуркації динамічних систем для діючої системи протидії фінансовим та кібер-шахрайствам; проведено оцінку ефективності національної системи протидії кібершахрайствам та легалізації кримінальних доходів на основі методів аналізу виживання; розроблені ключові алгоритми систем фінансового моніторингу та кібербезпеки, реалізовані із використанням BPMN-методології та програмного забезпечення Bizagi Studio в розрізі ідентифікації-верифікації клієнтів, автоматизованої перевірки фінансового моніторингу транзакцій, реакції на спробу-злочин з боку зовнішніх та внутрішніх інцидентів.

Основні показники виконання науково-дослідної роботи (наводяться кількість і вихідні дані показників, які отримані виконавцями НДР за темою дослідження):

№	Назва показника	Кількість	Вихідні дані (вказуються автори і назви статей, монографій, патентів, грантів, госпдоговорів, їх номери та дати опублікування (укладання))
1	1.Статті у журналах, що входять до науково-метричних баз даних WoS та/або Scopus з індексом SNIP ≥ 0.4 , од.	1	1. Samusevych, Y., Maroušek, J., Kuzmenko, O., Streimikis, J., & Vysochyna, A. (2021). Environmental taxes in ensuring national security: A structural optimization model. Journal of International Studies,

			14(2), 292-312. doi:10.14254/2071-8330.20 21/14-2/19
2	2.Статті, що входять до науково-метричних баз даних WoS або Scopus, які не оцінені за п.1, од.	2	1. S. Lieonov, T. Vasilyeva, S. Mynenko, T. Dotsenko BANKING IN DIGITAL AGE: EFFICIENCY OF ANTI-MONEY LAUNDERING SYSTEM Financial and credit activity: problems of theory and practice Vol. 2 No. 37 (2021) P.4-13 2. Kuzmenko O.Dotsenko T. Koibichuk V. DEVELOPMENT OF DATABASES STRUCTURE OF INTERNAL ECONOMIC AGENTS FINANCIAL MONITORING Фінансово-кредитна діяльність. 2021. №3 (прийнято до друку)
3	3.Статті у журналах, що входять до переліку фахових видань України та мають ISSN, статті у закордонних журналах, що не оцінені за пп.1-2, а також англomовні тези доповідей, що індексуються науково-метричними базами даних WoS або Scopus, од.	8	1. Леонов С.В., Кузьменко О.В., Койбічук В.В., Кушнерьов О.С. (2021). Розроблення моделі бізнес-процесу автоматизованого моніторингу фінансових операцій банком для протидії легалізації кримінальних доходів. Вісник СумДУ. Серія «Економіка», № 1. С. 9-16. https://doi.org/10.21272/1817-9215.2021.1-1 . 2. Кузьменко О. В., Доценко Т. В., Кушнерьов О. С. Досконалення системи фінансового моніторингу: автоматизація процесу верифікації клієнтів банку. Науковий погляд: економіка та управління.

			<p>2021. 2. С. 88-95. DOI: https://doi.org/10.32836/2521-666X/2021-72-13.</p> <p>3. Кузьменко О.В., Миненко С.В., Леонов С.В. & Квілінський О.С. (2021). Модель бізнес-процесу автоматизованого моніторингу платежів у системі «Клієнт-Банк». Механізм регулювання економіки. №1, 2021. С. 18-28. URL: https://mer.fem.sumdu.edu.ua/index.php?cmd=view_article&article_id=639&issue_id=48</p> <p>4. Кузьменко О.В., Доценко Т.В., Скринька Л.О. Економіко-математичне моделювання ефективності національної системи протидії кібершахрайствам та легалізації кримінальних доходів на основі методів аналізу виживання. Науковий Вісник МДУ. Серія "Економіка". 2021</p> <p>5. Кузьменко О.В., Доценко Т.В., Боженко В.В., Світлична А.О. ЗАКОНОМІРНОСТІ ЗДІЙСНЕННЯ КІБЕРАТАК В КРАЇНАХ ЕС НА ОСНОВІ ВИКОРИСТАННЯ АСОЦІАТИВНИХ ПРАВИЛ. Вісник СумДУ. Серія Економіка. 2021. №1. С. 95-103.</p> <p>6. Кузьменко О.В., Овчаренко В.О. АНАЛІЗ ЦИКЛІЧНОСТІ ПОКАЗНИКІВ ДІЯЛЬНОСТІ</p>
--	--	--	--

			<p>БАНКІВСЬКИХ УСТАНОВ В РОЗРІЗІ ВПРОВАДЖЕННЯ ІННОВАЦІЙНИХ ТЕХНОЛОГІЙ ОБСЛУГОВУВАННЯ КЛІЄНТІВ. Вісник СумДУ. Серія Економіка. 2021. №1. С. 179-187 7. Кузьменко О. В. Доценко Т.В.Миненко С.В.Шрамко Е.В. ВЗАЄМОЗАЛЕЖНІСТЬ FİNTECH ІННОВАЦІЙ, ФІНАНСОВИХ, КІБЕРНЕТИЧНИХ ЗЛОЧИНІВ ТА ЛЕГАЛІЗАЦІЇ КРИМІНАЛЬНИХ ДОХОДІВ ЗА ПОСЕРЕДНИЦТВА ФІНАНСОВИХ УСТАНОВ/. Вісник СумДУ. Серія Економіка.2021. №1. С.195-207 8. Леонов С.В., Кузьменко О.В., Койбічук В.В., Доценко Т.В., Діденко І.В. Контент-аналіз нормативно-довідкової інформації при організації баз даних внутрішнього фінансового моніторингу економічних агентів. Вісник СумДУ. Серія Економіка. 2021. №1. 221-232. URL: https://visnyk.fem.sumdu.edu.ua/issues/1_2021/25.pdf DOI: 10.21272/1817-9215.2021.1 -25</p>
4	4.Монографії за напрямом проекту, що опубліковані у закордонних виданнях офіційними мовами	0	-

	Європейського Союзу, друк.арк.		
5	Розділи монографій за напрямом проекту, що опубліковані у закордонних виданнях офіційними мовами Європейського Союзу, друк.арк.	0	-
6	Монографії за напрямом проекту, що опубліковані мовами, які не відносяться до мов Європейського Союзу, друк.арк.	0	-
7	Захищено виконавцями проекту дисертацій кандидата наук (доктора філософії, доктора наук), од.	2	1. Д - Яровенко Г.М., науковий консультант Кузьменко О.В. Інформаційна безпека як драйвер розвитку національної економіки, 08.00.03 - економіка та управління національним господарством, 13.05.2021 2. Д - Гончаренко Т.П., науковий консультант Пімоненко Т.В. Методологія формування та реалізації бізнес-стратегії банку, 08.00.08 – гроші, фінанси і кредит, 02.04.2021
8	Кількість та обсяг (тис.грн.) укладених загальноуніверситетських наукових грантів, за якими працювали виконавці НДР, та які фінансувались закордонними організаціями, од./тис.грн.	-	-
9	Кількість та обсяг (тис.грн.) укладених наукових госпдоговорів за якими працювали виконавці НДР, од./тис.грн.	1/10 тис. грн.	№53.16-2021.СП/03, ФОП Кушнерьов Сергій Олександрович (укладається)
10	Кількість та обсяг (тис.грн.) ліцензійних угод або договорів на «ноу-хау», що були передані замовникам на	-	-

	комерційній основі, од./тис.грн.		
11	Отримано охоронних документів на право інтелектуальної власності України або інших країн, од.	0	-
12	Кількість студентів-виконавців НДР з оплатою праці, осіб	1	Скринька Л.О.

3. Опис інших видів діяльності у рамках НДР. (проведення маркетингових досліджень, зареєстровані проекти законодавчих або нормативних актів, отримані індивідуальні гранти, формалізована співпраця із закордонними науковими партнерами, науковими установами НАН України, тощо):

- 1) Світлична А.О. "Статистичний аналіз та прогнозування випадків кібератак" (2 місце на 2-му етапі Всеукраїнського конкурсу студентських наукових робіт 2020-2021 з напрямку "Економічна аналітика та статистика", керівник - Яровенко Г.М.)
- 2) Ліцман М.А. "Статистичний аналіз та моделювання процесу виявлення шахрайства з кредитними картками" (3 місце на 2-му етапі Всеукраїнського конкурсу студентських наукових робіт 2020-2021 з напрямку "Економічна аналітика та статистика", керівник - Яровенко Г.М.)
- 3) Радько В. "Assessment of the fraud probability in the process of lending to the bank customers" (дипломна робота бакалавра зі спеціальності 051 "Економіка" ("Бізнес аналітика"), керівник - Яровенко Г.М.)
- 4) Дятленко А.О. "Моделювання та прогнозування кібератак для економічних агентів" (дипломна робота магістра зі спеціальності 051 "Економіка" ("Економічна кібернетика"), керівник - Яровенко Г.М.)
- 5) Скринька Л.О. "Економіко-математичне моделювання ефективності національної системи протидії кібершахрайствам та легалізації кримінальних доходів на основі методів аналізу виживання" (дипломна робота магістра зі спеціальності 051 "Економіка" ("Економічна кібернетика"), керівник - Кузьменко О.В.)
- 6) Леонов С.В., Кузьменко О.В., Койбічук В.В. Легалізація кримінальних доходів у банку на основі моделі бізнес-процесу автоматизованого моніторингу фінансових операцій// Materials of the XVII International scientific and practical Conference Modern scientific potential - 2021 , February 28 - March 7, 2021: Sheffield. Science and education LTD. – С. 33-35
- 7) Olha Kuzmenko, Serhii Minenko INTERDEPENDENCE BETWEEN FINTECH INNOVATION, FINANCIAL CRIME, CYBERCRIME AND MONEY LAUNDERING THROUGH FINANCIAL INSTITUTIONS. Materials of the International scientific and practical Conference Socio-Economic Challenges - 2021
- 8) Litsman M., Yarovenko H. STATISTICAL ANALYSIS AND MODELING OF THE PROCESS OF DETECTING CREDIT CARD FRAUD. The driving force of science and trends in its development: collection of scientific papers «SCIENTIA» with Proceedings of the I International Scientific and Theoretical Conference (Vol. 1), January 29, 2021. Coventry, United Kingdom: European Scientific Platform. P. 76-78.
- 9) Svitlychna A., Yarovenko H. STATISTICAL ANALYSIS AND FORECASTING OF CYBER ATTACKS. The driving force of science and trends in its development: collection of scientific papers «SCIENTIA» with Proceedings of the I International Scientific and Theoretical Conference (Vol. 3), January 29, 2021. Coventry, United Kingdom: European Scientific Platform. P. 17-19.

4. Перелік виконавців НДР:

- Яровенко Г.М. – керівник НДР, провідний науковий співробітник;
- Кузьменко О.В. – відповідальний виконавець НДР, провідний науковий співробітник;
- Леонов С.В. – виконавець НДР, провідний науковий співробітник;

- Гончаренко Т.П. – виконавець НДР;
- Скринька Л.О. – виконавець НДР;

Начальник НДЧ Денис Курбатов _____

Керівник НДР (відповідальний виконавець): Яровенко Г.М.

(заповнюючи дану електронну форму, підтверджую, що подані відомості достовірні та не потребують окремого засвідчення додатковим підписом)

дата: 07/02/2021

e-mail: a.yarovenko@uabs.sumdu.edu.ua