

Облікова картка ДіР



I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0221U101310

Державний реєстраційний номер: 0118U000058

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 19-01-2021

II. Етап виконання ДіР

Номер етапу: 3

Назва етапу: Розробка практичних методичних рекомендацій щодо формування переліку ризиків з урахуванням застосування мережових схем для протидії ВК/ФТРЗ

Початок етапу: 01.2020

Закінчення етапу: 12.2020

Вид звітнього документа: Остаточний звіт

III. Відомості про виконавця ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Харківський національний економічний університет імені Семена Кузнеця

Код за ЄДРПОУ: 02071211

Місцезнаходження: проспект Науки, буд. 9-а, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61166, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380577020304, 380577020717

IV. Відомості про співвиконавців ДіР

V. Відомості про замовника ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Міністерство освіти і науки України

Код за ЄДРПОУ: 38621185

Місцезнаходження: просп. Перемоги, буд. 10, м. Київ, Київська обл., 01135, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Кабінет Міністрів України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380444813221

VI. Джерела, напрями та обсяги фінансування ДіР

Підстава для проведення ДіР: 34 - договір (замовлення) з центральним органом виконавчої влади, академією наук (головними розпорядниками бюджетних коштів на проведення НДДКР)

Напрямок фінансування: 2.1 - фундаментальні дослідження

Джерела фінансування

7713 - кошти держбюджету

Код програмної класифікації видатків і кредитування (КПКВК): 2201040

Фактичний обсяг фінансування (тис. грн.): 474.444
--

VII. Відомості про ДіР

Назва роботи українською:

Ризик-орієнтований підхід у забезпеченні протидії відмиванню коштів, фінансуванню тероризму та розповсюдження зброї масового знищення

Назва роботи англійською:

Risk-oriented approach to anti-money laundering, financing of terrorism and the proliferation of weapons of mass destruction

Реферат українською:

Об'єктом дослідження обрано процеси протидії відмиванню коштів, фінансуванню тероризму та розповсюдженню зброї масового знищення (далі – ВК/ФТРЗ), а його предметом – теоретико-методологічні положення та практичні рекомендації щодо запровадження ризик-орієнтованого підходу (далі – РОП) для забезпечення протидії ВК/ФТРЗ. Метою НДР є розробка теоретико-методологічних положень та формування практичних рекомендацій щодо пошуку моделей оцінки, контролю та ефективного управління ризиками для забезпечення протидії ВК/ФТРЗ. Для досягнення мети у роботі: вперше побудовано систему ризик-орієнтованих ознак для виявлення та протидії ризикам ВК/ФТРЗ, надано практичні рекомендації з їх використання; удосконалено методичні рекомендації щодо обґрунтування переліку інформаційно доступних ризик-орієнтованих ознак для попередження суб'єктами первинного фінансового моніторингу (далі – СПФМ) реалізації загроз ВК/ФТРЗ; удосконалено методичний підхід до формування моделей ризик-контролю клієнтів з урахуванням ймовірностей реалізації ними мережевих схем; удосконалено методичний інструментарій оцінки комплаєнс-ризиків банків у сфері ВК/ФТРЗ; розроблено аналітичний підхід до оцінювання ефективності ризик-контролю клієнтів банку в системі фінансового моніторингу та організаційне забезпечення реалізації оновлених наглядових функцій у сфері фінансового моніторингу на основі РОП.

Реферат англійською:

The study intended to investigate the processes of combating money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons with respect to the study scope, namely the theoretical and methodological provisions as well as operational guidelines for implementing a risk-based approach to combating money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons. The research work was targeted at developing theoretical and methodological provisions and forming operational guidelines in order to find models for assessment, control and effective risk management with a focus on combating money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons. The achievement of this research target included the following activities: forming-up an original system of risk-oriented features with the aim to identify and combat the risks of money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons, as well as providing operational guidelines for the use of these features; refining the instructional guidelines for the substantiated list of information-available risk-oriented features to render support to reporting institutions in preventing the threat of money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons; perfecting the procedural approach to the formation of risk control models applied to clients taking into account the fact that they might implement networking schemes; advancing the procedural tools aimed to assess the compliance risks faced by banks in the field of money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons; developing an analytical approach introduced while assessing the effectiveness of risk control applied to the bank's clients in the financial monitoring system and organizational support for the implementation of updated supervisory functions in financial monitoring based on the risk-oriented approach.

Індекс УДК: 342.9, 342.9:346.9:336.4

Коди тематичних рубрик:10.17

Керівники роботи

Власне Прізвище Ім'я По-батькові: Колодізев Олег Миколайович

Науковий ступінь: д. е. н.

Вчене звання: професор

Ідентифікатор ORCID ID:

Додаткова інформація:

VIII. Наукова (науково-технічна) продукція (НТП)

Назва НТП українською: Система ризик-орієнтованих ознак для виявлення та протидії ризикам ВК/ФТРЗ. Методичні рекомендації до обґрунтування переліку інформаційно доступних ризик-орієнтованих ознак, спрямованих на виявлення та протидію у СПФМ ВК/ФТРЗ. Методичний підхід до формування моделей ризик-контролю клієнтів з урахуванням ймовірностей реалізації ними мережевих схем. Методичний інструментарій оцінки комплаєнс-ризиків банків у сфері ВК/ФТРЗ.

Назва НТП англійською: A system of risk-oriented features aimed to identify and combat the risks of money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons. Instructional guidelines for the substantiated list of information-available risk-oriented features aimed to render support to reporting institutions in identifying and combating money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons. A procedural approach to the formation of risk control models applied to clients taking into account the fact that they might implement networking schemes. Procedural tools aimed to assess the compliance risks faced by banks in the field of money laundering, terrorist financing and proliferation of mass destruction weapons.

НТП, яку передбачалося створити:

Причини, через які НТП не було створено:

Отримані результати: розроблено практичні, методичні рекомендації щодо формування переліку ризик-орієнтованих ознак, спрямованих на раннє виявлення та протидію у СПФМ ВК/ФТРЗ; створено моделі ризик-контролю клієнтів щодо

Галузь застосування: для суб'єктів державного та первинного (фінансових установ ринку фінансових послуг) фінансового моніторингу, спеціально визначених СПФМ (нотаріуси, аудитори та ін.).

Реєстраційний номер картки технології:

Опис НТП: Побудована система ризик-орієнтованих ознак для виявлення та протидії ризикам ВК/ФТРЗ узгоджено поєднує комплекс визначених за взаємопов'язаними ризиками ВК/ФТРЗ критеріїв. Її особливістю є: обґрунтовані для типових клієнтів банків критерії оцінювання їх рівнів ризиків; інформаційно доступні критерії виявлення ймовірності залучення банків до процесів відмивання коштів за статичними та динамічними показниками (фінансової стійкості, сукупного рівня ризику, динамічної зміни обсягів коштів у касі та на рахунках клієнтів); врахування існування мереж зв'язків (зв'язаності) СПФМ, їх клієнтів. Методичні рекомендації до обґрунтування переліку інформаційно доступних ризик-орієнтованих ознак, спрямованих на виявлення та протидію у СПФМ ВК/ФТРЗ, ґрунтуються на доведенні гіпотез щодо зв'язку параметрів діяльності банків як СПФМ та характеристик їх клієнтів із ризиком відмивання коштів, заходами фінансового моніторингу в частині заходів впливу за порушення вимог законодавства у сфері запобігання та протидії ВК/ФТРЗ. Методичний підхід до формування моделей ризик-контролю клієнтів з урахуванням ймовірностей реалізації ними мережевих схем враховує формалізацію та поєднання зв'язків між параметрами одно- і дворівневих моделей ризик-контролю клієнтів, з типовими параметрами мережевих схем для забезпечення ВК/ФТРЗ і відповідними порушеннями банківських установ у сфері фінансового моніторингу, що уможливорює оцінювання й забезпечує підвищення результативності моделей ризик-контролю клієнтів шляхом застосування сценарного моделювання. Методичний інструментарій оцінки комплаєнс-ризиків банків у сфері ВК/ФТРЗ ґрунтується на використанні таких критеріїв як рівень розвитку системи комплаєнсу, досвід застосування за порушення вимог законодавства заходів впливу, рівень операційного ризику, плинність персоналу та передбачає формування бази для аналітичного дослідження (з використанням коефіцієнтного підходу та методу бінарних характеристик), побудову композитного індикатору методом зважених сум.

Соціально-економічна спрямованість НТП: підвищенні рівня безпеки та обороноздатності країни завдяки запровадженню РОП у систему протидії ВК/ФТРЗ у гібридних війнах сучасності

Вплив НТП на довкілля:

Впровадження НТП: Впроваджено

Практична реалізація НТП

Початок етапу:

Закінчення етапу:

Споживачі продукції:

Перспективні ринки:

Характер співробітництва з інвестором

Потрібний обсяг інвестицій, тис. грн.:

Права, що надаються інвестору після завершення роботи:

Наявність бізнес-плану:

Техніко-економічне обґрунтування:

Потенціальний обсяг продажу, тис. грн.:

Очікуваний термін окупності (років):

Додаткова інформація:

IX. Бібліографічний опис

Х. Заключні відомості

Керівник юридичної особи

Пономаренко Володимир Степанович

д. е. н., 08.00.04

Перелік осіб-виконавців

Андрійченко Жанна Олегівна

(к.е.н.)

Безродна Олена Сергіївна

(к.е.н.)

Вейц Олександр Ігорович

Внукова Наталія Миколаївна

(д.е.н., 08.06.02)

Гур'янова Лідія Семенівна

(д.е.н., 08.00.11)

Жмурко Тетяна Олексіївна

Киркач Світлана Миколаївна

Колодізев Олег Миколайович

(д.е.н.)

Лебідь Олеся Вікторівна

(к.е.н., 08.00.04)

Лозинська Ольга Іванівна

Мінц Олексій Юрійович

(д.е.н., 08.00.11)

Нечипоренко Дарія Іванівна

Огородня Євгенія Миколаївна

Плескун Інна Володимирівна

Полянський Владислав Олександрович

Пономаренко Володимир Степанович

(д. е. н.)

Сідельов Павло Анатолійович

Цибульська Альбіна Рубенівна

Чмутова Ірина Миколаївна

(д.е.н., 08.00.08)

Шорох Валерія Дмитрівна

Відповідальний за підготовку облікових документів

Шелкунова Наталія Леонідівна

Телефон

+38 (057) 702-06-70

Реєстратор

**Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є
відповідальним за реєстрацію наукової
діяльності**

