Облікова картка ДіР

I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0225U004074

Державний реєстраційний номер: 0124U004045

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 05-11-2025

II. Етап виконання ДіР

Номер етапу: 1

Назва етапу: Теоретико-методичні засади впровадження цифрових фінансових технологій

Початок етапу: 07.2024

Закінчення етапу: 12.2024

Вид звітного документа: Проміжний звіт

III. Відомості про виконавця ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Національний технічний університет "Харківський політехнічний інститут"

Код за ЄДРПОУ: 02071180

Місцезнаходження: вул. Кирпичова, буд. 2, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61002, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380577076634

IV. Відомості про співвиконавців ДіР

V. Відомості про замовника ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Товариство з обмеженою відповідальністю "Науково-виробнича компанія "Інноваційні нафтогазові технології"

Код за ЄДРПОУ: 44189818

Місцезнаходження: пров. Унецький, буд. 10, м. Харків, Харківський р-н., Харківська обл., 61066, Україна

Форма власності:

Сфера управління:

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380971585081

VI. Джерела, напрями та обсяги фінансування ДіР

Підстава для проведення ДіР: 52 - договір з вітчизняною організацією (органами місцевої ради, фондом, асоціацією, концерном тощо)

Напрям фінансування: 2.2 - прикладні дослідження і розробки

Джерела фінансування

7722 - кошти підприємств, установ, організацій України

Фактичний обсяг фінансування (тис. грн.): 5.000

VII. Відомості про ДіР

Назва роботи українською:

Розвиток цифрових фінансових технологій в умовах діджиталізації економічних процесів

Назва роботи англійською:

Digital financial technologies development in terms of economic processes digitization

Реферат українською:

У дослідженні розглянуто актуальну проблему підвищення ефективності управління інвестиційними портфелями в умовах високої волатильності фінансових ринків та цифрової трансформації економіки. Особливу увагу приділено вдосконаленню методологічного підходу до формування інвестиційних стратегій із урахуванням сучасних викликів, таких як нестабільність ринків, поведінкові фактори, цифровізація активів та зростання ролі децентралізованих фінансових технологій (DeFi).Метою дослідження є розробка методичних положень та практичних рекомендацій щодо розвитку цифрових фінансових технологій в умовах діджиталізації економічних процесів. Об'єктом дослідження виступає інвестиційна діяльність у цифровому середовищі, а предметом - методи прогнозування, оцінювання та управління інвестиційними портфелями з урахуванням ризиків і нестабільності.У процесі дослідження застосовано методи економетричного моделювання (ARIMA, GARCH, LASSO, LSTM), аналізу часових рядів, багатофакторного аналізу, а також інструменти глибокого навчання та підкріплювального навчання для динамічного балансування портфелів. Запропоновано інтегральний критерій оцінки ефективності портфеля, що враховує фінансові, соціальні та технологічні параметри, зокрема для оцінювання інвестиційної привабливості DeFi-протоколів.Практична значущість роботи полягає у можливості застосування розроблених моделей для підвищення стійкості інвестиційних стратегій, зниження ризиків та забезпечення адаптивності до ринкових змін. Результати можуть бути використані як у традиційних фінансових установах, так і в інноваційних цифрових екосистемах, зокрема у сфері нафтогазовидобутку, де цифрові фінансові рішення сприяють ефективному фінансуванню технологій отримання та спалювання композиційних палив з відходів нафтовидобувної та нафтопереробної промисловості.

Реферат англійською:

The study addresses the pressing issue of improving investment portfolio management in the context of high financial market volatility and ongoing digital transformation of the economy. Special attention is given to refining the methodological approach to investment strategy formation, considering contemporary challenges such as market instability, behavioural factors, asset digitalization, and the growing role of decentralized financial technologies (DeFi). The aim of the research is to develop methodological principles and practical recommendations for the advancement of digital financial technologies under conditions of economic digitalization. The object of the study is investment activity in the digital environment, while the subject is the methods of forecasting, evaluating, and managing investment portfolios with consideration of risk and uncertainty. The research applies econometric modelling techniques (ARIMA, GARCH, LASSO, LSTM), time series analysis, multifactor analysis, as well as tools from deep learning and reinforcement learning for dynamic portfolio rebalancing. An integrated criterion for portfolio performance evaluation is proposed, which incorporates financial, social, and technological parameters -particularly relevant for assessing the investment attractiveness of DeFi protocols. The practical significance of the study lies in the applicability of the developed models to improve the resilience of investment strategies, mitigate risks, and ensure adaptability to market dynamics. The results can be used by both traditional financial institutions and innovative digital ecosystems, particularly in the oil and gas extraction sector, where digital financial solutions enable efficient funding of technologies for the production and combustion of composite fuels derived from oil and gas industry waste.

Індекс УДК: 614.2:338.26, 336.76:338.2, 336.77.067.22; 339.72

Коди тематичних рубрик:76.75.75.07, 82.13.25, 06.73.35

Керівники роботи

Власне Прізвище Ім'я По-батькові: Кузнецова Світлана Олександрівна

Науковий ступінь: к. е. н.

Вчене звання: доц.

Ідентифікатор ORCID ID:

Додаткова інформація:

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

Назва НТП українською: Розвиток цифрових фінансових технологій в умовах діджиталізації економічних процесів

Назва НТП англійською: Digital financial technologies development in terms of economic processes digitization

НТП, яку передбачалося створити: Створено

Причини, через які НТП не було створено:

Отримані результати: Інше (Підвищення ефективності цифрових фінансових технологій)

Галузь застосування: 72.20 Дослідження й експериментальні розробки у сфері суспільних і гуманітарних наук

Реєстраційний номер картки технології:

Опис НТП: У роботі розглянуто сучасні підходи до управління інвестиційними портфелями в контексті цифрової трансформації та розвитку децентралізованих фінансів (DeFi). Запропоновано комплексний інтегральний критерій оцінки ефективності інвестиційних стратегій, що враховує сучасні економічні та цифрові реалії. Особливу увагу приділено синергії класичних фінансових підходів із цифровими технологіями управління активами. У контексті розвитку технологій нафтогазовидобутку, робота підкреслює важливість інвестицій у інноваційні рішення, зокрема в технології отримання та спалювання композиційних палив з відходів нафтовидобувної та нафтопереробної промисловості. Окремі питання присвячено аналізу ринку DeFi, його потенціалу для фінансування інновацій у сфері нафтогазовидобутку. Запропоновано індикатор DIAD для оцінки інвестиційної привабливості DeFi-протоколів, що може бути адаптований для аналізу проектів у сфері енергетики.Робота також містить SWOT-аналіз DeFi, розгляд ризиків та можливостей.

Соціально-економічна спрямованість НТП: Інше (Підвищення ефективності системи управління суб'єкта господарювання)

Вплив НТП на довкілля:

Впровадження НТП: Впроваджено

Практична реалізація НТП

Початок етапу: 07.2024

Закінчення етапу: 04.2025

Споживачі продукції: ТОВ «Науково-виробнича компанія «Інноваційні нафтогазові технології»

Перспективні ринки: Нафтогазові ринки, ринки України

Характер співробітництва з інвестором

Потрібний обсяг інвестицій, тис. грн.:

Права, що надаються інвестору після завершення роботи:

Наявність бізнес-плану:

Техніко-економічне обгрунтування:

Потенціальний обсяг продажу, тис. грн.:

Очікуваний термін окупності (років):

Додаткова інформація:

IX. Бібліографічний опис

1 Кузнецова С.О., Писаковський А. О. Децентралізовані фінанси в сучасній фінансовій системі: розвиток та ризики. Цифрова економіка та економічна безпека. 2024. № 4 (13). С. 154-158. doi: 10.32782/dees.13-23

2 Ладиненко О. А. Теоретичне підгрунтя управління вартістю бізнесу. Науковий вісник Одеського національного економічного університету. 2024. № 7-8 (320-321). С. 95-102. : https://doi.org/10.32680/2409-9260-2024-7-8-320-321-95-102

3 Кузнецова С., Строков Є., Кузнецов С. Обґрунтування необхідності запровадження оцінювання фінансових інструментів і технологій. Економіка та суспільство. 2024. № 65. https://doi.org/10.32782/2524-0072/2024-65-95

4 Кузнецова С. О., Івахно П. В. Вплив оцінок фінансових інструментів за справедливою вартістю на зміну цін на акції. Вісник Національного технічного університету "ХПІ" (економічні науки). 2024. № 4. С. 49-53. doi: 10.20998/2519-4461.2024.4.49

5 Лагода Ю.І. Теоретичний базис формування інвестиціної банківської стратегії фінансування венчурного бізнесу. Бізнес Інформ. 2024. №8. С. 365–371. https://doi.org/10.32983/2222-4459-2024-8-365-371

X. Заключні відомості

Керівник юридичної особи — Марченко Андрій Петрович
д. т. н., 05.05.03

Перелік осіб-виконавців

Івахно Павло Вікторович

Альошин Сергій Юрійович
(к. е. н., доц., 08.00.04)

Колонтаєвський Роман Генадійович

Корешников Федір Юрійович

Кузнецов Сергій Володимирович

Лагода Юрій Іванович

Ладиненко Олег Анатолійович

Литвинов Іван Юрійович

Писаковський Антон Олексійович

Пронін Альберт Альбертович

Строков Євген Михайлович
(к. е. н., доц., 08.00.04)

Ткаченко Марина Олексіївна
(к. е. н., доц., 08.00.04)

Чапайло Вадим Валерійович

Відповідальний за підготовку облікових документів — Гуренко Юлія Іванівна

Телефон — 0506098392

Реєстратор — Юрченко Тетяна Анатоліївна

Керівник відділу УкрІНТЕІ, що є відповідальним за реєстрацію наукової діяльності



Юрченко Тетяна Анатоліївна