

Облікова картка ДіР



I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0221U107283

Державний реєстраційний номер: 0121U100473

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 30-12-2021

II. Етап виконання ДіР

Номер етапу: 1

Назва етапу: Концептуалізація сегменту соціально-відповідального інвестування як основи трансформації фондового ринку за фрактальною моделлю

Початок етапу: 01.2021

Закінчення етапу: 12.2021

Вид звітного документа: Проміжний звіт

III. Відомості про виконавця ДіР

Повне найменування юридичної особи (або ПІБ фізичної особи): Сумський державний університет

Код за ЄДРПОУ: 05408289

Місцезнаходження: вул. Римського-Корсакова, буд. 2, м. Суми, Сумський р-н., Сумська обл., 40007, Україна

Форма власності:

Сфера управління: Міністерство освіти і науки України

Ідентифікатор ROR: Не застосовується

Розмір організації:

Телефон: 380542334058

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: проспект Берестейський, буд. 10, м. Київ, 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: 2.2 - прикладні дослідження і розробки

Джерела фінансування

7713 - кошти держбюджету

Код програмної класифікації видатків і кредитування (КПКВК): 2201040

Фактичний обсяг фінансування (тис. грн.): 660.000
--

VII. Відомості про ДіР

Назва роботи українською:

Фрактальна модель трансформації фондового ринку України: соціально-відповідальне інвестування для досягнення Цілей сталого розвитку

Назва роботи англійською:

Fractal model of Ukraine's stock market transformation: socially responsible investing to the Sustainable Development Goals achievement

Реферат українською:

Проблема формування ефективного фінансового інструментарію для досягнення Цілей сталого розвитку (ЦСР) ООН визнана в академічних та експертних колах першочерговою для подолання глобальних проблем людства. Вирішення зазначеної проблеми розвиненими країнами світу лежить у площині стимулювання розвитку сегменту соціально-відповідального інвестування у структурі фондових ринків. Цей проєкт передбачає трансформацію фондового ринку України на основі фрактального моделювання та створення в його структурі сегменту відповідального інвестування (ВІ), розробку його нових фінансових продуктів, нормативного, інформаційного та регуляторного забезпечення. У ході виконання першого етапу реалізації проєкту формалізовано взаємозв'язок між ВІ та персистентністю фондового ринку на основі методів R/S-аналізу та фракційного інтегрування на прикладі динаміки 24 ESG та традиційних індексів MSCI, що дозволяє підтвердити відсутність різниці у динаміці цих індексів та обґрунтувати активізацію зусиль щодо подолання «грінвошингу» та інформаційної асиметрії на ринках ВІ, підвищення їх транспарентності; розроблено систему моделей і програмних комплексів для оцінювання інвестиційної привабливості для ВІ на різних рівнях (країн, регіонів України, державних компаній), що дозволило виявити найбільш привабливі кластери цих суб'єктів, тригери, детермінанти та заходи щодо підвищення їх інвестиційної привабливості; удосконалено структурно-функціональний підхід до ідентифікації відповідального інвестування, його сегментації та типології превалюючих стратегій на основі методів бібліометричного та кластерного аналізу. Отримані результати дозволять систематизувати та розширити наявні знання щодо сегменту соціально-відповідального інвестування як основи трансформації фондового ринку за фрактальною моделлю та виступатимуть в якості теоретичного базису для реалізації наступних етапів проєкту

Реферат англійською:

The problem of creation effective financial tools to achieve the UN Sustainable Development Goals (SDGs) is recognized in academic and expert circles as a priority for overcoming the global problems of humanity. The solution to this problem by developed countries lies in stimulating the development of the segment of socially responsible investment in the structure of stock markets. The project envisages the transformation of the stock market of Ukraine on the basis of fractal modeling and the creation in its structure of a segment of responsible investment (RI), development of its new financial products, regulatory, informational and regulatory support. During the first stage of the project, the relationship between RI and stock market persistence was formalized on the basis of R/S-analysis and fractional integration methods on the example of 24 ESG dynamics and traditional MSCI indices, which confirms the absence of differences in the dynamics of these indices and substantiates intensification of efforts to overcome the «greenwashing» and information asymmetry in the markets of RI, increasing their transparency; developed a system of models and software complexes for assessing investment attractiveness for RI at different levels (countries, regions of Ukraine, companies), which allowed to identify the most attractive clusters of these entities, triggers, determinants and measures to increase their investment attractiveness; the structural and functional approach to the identification of RI, its segmentation and the typology of prevailing strategies based on the methods of bibliometric and cluster analysis was improved. The obtained results allow to systematize and expand the existing knowledge about the segment of socially responsible

investment as a basis for the transformation of the stock market according to the fractal model

Індекс УДК: 336.1; 336.22, 336.76:330.322:502.131.1(477)(047.31)

Коди тематичних рубрик: 06.73.15

Керівники роботи

Власне Прізвище Ім'я По-батькові: Пластун Олексій Леонідович

Науковий ступінь: д. е. н.

Вчене звання: професор

Ідентифікатор ORCID ID:

Додаткова інформація:

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

IX. Бібліографічний опис

1. Caporale, G.M., Plastun, A., Oliinyk, V. (2021). The frequency of one-day abnormal returns and price fluctuations in the forex Journal of Applied Economics, VOL. 24, NO. 1, 401–415 <https://doi.org/10.1080/15140326.2021.1953914> (Scopus, Q2)
2. Plastun Alex, Xolani Sibande, Rangan Gupta, Mark E. Wohar, (2021), Evolution of the price effects after one-day abnormal returns in the us stock market, The North American Journal of Economics and Finance, 57 <https://doi.org/10.1016/j.najef.2021.101405> (Scopus, Q2)
3. Plastun, Alex, Ahniia Havrylina, Liudmyla Sliusareva, Nataliya Strochenko and Olga Zhmaylova (2021). Daily abnormal returns and price effects in the “passion investments” market. Investment Management and Financial Innovations, 18(4), 141–149. doi:10.21511/imfi.18(4).2021.13 (Scopus, Q3)
4. Situm Mario, Alex Plastun, Inna Makarenko, Yuliia Serpeninova and Giuseppe Sorrentino (2021). SDG 3 and financing instruments in Austria and Ukraine: Challenges and perspectives. Problems and Perspectives in Management, 19(3), 118–135. doi:10.21511/ppm.19(3).2021.11 (Scopus, Q3)
5. Alex Plastun, Inna Makarenko, Tetiana Grabovska, Ricardo Situmeang and Serhii Bashlai (2021). Sustainable Development Goals in agriculture and responsible investment: A comparative study of the Czech Republic and Ukraine. Problems and Perspectives in Management, 19(2), 65–76. doi:10.21511/ppm.19(2).2021.06 (Scopus, Q3)
6. Caporale, G.M., Plastun, A. (2021). Gold and oil prices: abnormal returns, momentum and contrarian effects. Financial Markets and Portfolio Management, 35, 353–368 <https://doi.org/10.1007/s11408-021-00380-w> (Scopus, Q4)
7. Fedir Zhuravka, Hanna Filatova, Petr Šuleř and Tomasz Wołowiec (2021). State debt assessment and forecasting: time series analysis. Investment Management and Financial Innovations, 18(1), 65–75 [http://dx.doi.org/10.21511/imfi.18\(1\).2021.06](http://dx.doi.org/10.21511/imfi.18(1).2021.06)
8. Caporale, G. M., Plastun, A., & Oliinyk, V. (2021). Bitcoin Returns and the Frequency of Daily Abnormal Returns. Ledger, 6. <https://doi.org/10.5195/ledger.2021.216> (WoS)
9. Caporale, G.M. and Plastun, A. (2021), "Daily abnormal price changes and trading strategies in the FOREX", Journal of Economic Studies, Vol. 48 No. 1, pp. 211–222. <https://doi.org/10.1108/JES-11-2019-0503> (Scopus + WoS, Q2)

10. Makarenko S., Plastun A., Makarenko I., Kozmenko S., Kozmenko O. (2021). Reforms and competitiveness in the ukrainian audit market Polish Journal of Management Studies 2021; 23 (2): 305–320 (Scopus + WoS, Q3)
11. Макаренко, І. О., Воронцова, А. С. ., Єльнікова, Ю. В., & Ласукова, А. С. (2021). Бібліометричний аналіз наукових досліджень з питань відповідального інвестування. Проблеми теорії та методології бухгалтерського обліку, контролю і аналізу, 1(48), 70–76. [https://doi.org/10.26642/pbo-2021-1\(48\)-70-76](https://doi.org/10.26642/pbo-2021-1(48)-70-76)
12. Воронцова, А. С., Єльнікова, Ю. В., Рудиченко, А. Г. Структурно-функціональний підхід до ідентифікації відповідального інвестування // Вісник Сумського державного університету. Серія Економіка. 2021. № 1. С. 36–42. DOI: 10.21272/1817-9215.2021.1-5.
13. Artemenko A. Monetary measures and currency regulation during macroeconomic instability and world uncertainty. International Scientific Journal Economics & Education (Riga, Latvia). 2021. № 06 (01). P. 65–71. DOI: <https://doi.org/10.30525/2500-946X/2021-1-1>
14. Воронцова А. С., Пластун О. Л., Філатова Г. П., Костенко О. М., Джобава Е. Г. (2021). Обґрунтування місця сегменту відповідального інвестування в архітектурі фондового ринку. European Journal of Management Issues (подано до друку)
15. Єльнікова Ю.В., Макаренко І.О., Артеменко А.С., Городецька М.О. Типологія стратегій відповідального інвестування. European Journal of Management Issues. 2021 (подано до друку)
16. Serpeninova, Yu., Makarenko, I., Plastun, A., Babko, A., & Gasimova, G. (2020). Mapping Of The Responsible Investments Instruments In Sdg 3 ‘Good Health And Well-Being’ Financing: EU And US Experience. Health Economics and Management Review, 1(1), 106–115. <https://doi.org/10.21272/hem.2020.1-10>
17. Vorontsova A. Makarenko I. Petrushenko Yu. Ostapchuk T. Boiko O. Categories of Responsible Investment: Bibliometric Landscape. Proceedings of the 11th International Conference on Intelligent Data Acquisition and Advanced Computing Systems: Technology and Application (IDAACS). Vol 2. pp 143–148 (Indexing in Scopus expected)
18. Makarenko S. Legenchuk S. Makarenko I. Audit of sustainability reporting and SDGs 1, 2, 12 disclosure : case of top Ukrainian agroholdings. International conference “Accounting and Auditing in the Process of International Harmonization”. University of Economics in Bratislava, Slovak Republic (7–9 September 2021). VSE - 2021. P. 96–101. (indexing in Scopus expected)
19. Plastun A. Sustainable development goal 7 “Affordable and clean energy”: financial and research gap. in Makarenko, I., Plastun, A., Serpeninova, Yu. D. (2021). Bridging the financial and academic gap in key Sustainable Development Goal(s): comprehensive bibliometric analysis. Szczecin: Centre of Sociological Research, p. 44–73. ISBN 978-83-959336-6-0
20. Makarenko I. Sustainable development goal 9 “Industry, innovation and infrastructure”: financial and research gap. in Makarenko, I., Plastun, A., Serpeninova, Yu. D. (2021). Bridging the financial and academic gap in key Sustainable Development Goal(s): comprehensive bibliometric analysis. Szczecin: Centre of Sociological Research, p. 44–73. ISBN 978-83-959336-6-0
21. Сучасний інноваційний менеджмент і фінансова аналітика: методологія і практика: монографія / Т.М. Болгар, Карчева Г.Т., Крамаренко Г.О. та ін; за ред. Т.М. Болгар. – Дніпро: Університет імені Альфреда Нобеля, 2021. – 232 с. (Пластун О.Л. Традиційні та ESG-індекси: погляд з позиції персистентності даних, стор. 64–72)
22. Рішення про реєстрацію договору, який стосується права автора на твір 6266 (2021) Макаренко І.О., Пластун О. Л., Макаренко С. М., Гавриліна А.В., Жужа Л.М., Рудиченко А. Г. Методика аналізу концентраційних процесів на ринку аудиторських послуг у контексті забезпечення транспарентності інвестиційного середовища
23. Авторське свідоцтво на науковий твір 106825 (2021) Макаренко І.О., Пластун О.Л., Сухонос В.В., Серпенінова Ю. С., Кравченко О.В., Овчарова Н. В. Структурно-логічна схема сегментації ринку аудиторських

послуг банків України у контексті забезпечення транспарентності їх інвестиційного середовища

24. Авторське свідоцтво на науковий твір 106660 (2021) Макаренко І.О., Пластун О. Л., Серпенінова Ю. С., Єльнікова Ю.В., Воронцова А.С. Методика бібліометричного аналізу наукових публікацій щодо інвестиційного забезпечення Цілі сталого розвитку 3 «Міцне здоров'я та благополуччя».

25. Авторське свідоцтво на науковий твір 107703 (2021) Пластун О.Л., Макаренко І.О., Петрушенко Ю.М., Філатова Г.П., Артеменко А.С. Роль відповідальних інвестицій у досягненні цілей сталого розвитку у сільському господарстві

26. Захищено у разовій спеціалізованій вченій раді ДФ 55.051.19 Сумського державного університету дисертаційну роботу Філатової Ганни Петрівни на здобуття наукового ступеня доктор філософії за спеціальністю 072 фінанси, банківська справа та страхування на тему: «Боргова безпека в системі забезпечення економічної безпеки держави» 22. 06. 2021

27. Захищено у спеціалізованій вченій раді Д 55.051.06 Сумського державного університету дисертаційну роботу Єльнікової Юлії Василівни на здобуття наукового ступеня доктора економічних наук за спеціальністю 08.00.03 - економіка та управління національним господарством на тему: «Відповідальне інвестування у контексті реалізації державної інвестиційної політики» 14.05.2021

28. Макаренко І. О., Костенко О. М., Джобава Е. Г. Інвестиційні механізми постковідного відновлення економіки: європейський досвід. ІІ Міжнародна науково-практична конференція з проблем вищої освіти і науки «Сучасні виклики сталого розвитку бізнесу». м. Житомир, Житомирська політехніка, 04-05 листопада 2021 р. (подано до друку).

29. Воронцова А.С., Городецька М. Аналіз стану відповідального інвестування в умовах COVID-19. Синергетичні драйвери розвитку обліку, податкового аудиту та бізнес-аналітики : збірник тез за матеріалами Міжнародної науково-практичної інтернет-конференції (14-15 квітня 2021 р.). Ірпінь: Університет ДФС України, 2021. С. 467- 469.

30. Рудиченко А. Тренди у розвитку відповідального інвестування. Інновації в науці: сучасний вимір: матеріали Міжнародної науково-практичної інтернет-конференції молодих дослідників (22 квітня 2021 року, м. Суми). – Суми: ФОП Цьома С.П., 2021. С. 349-350.

31. Plastun O. Price effects after one-day abnormal returns: esg vs traditional indices // Socio-Economic Challenges : Proceedings of the International Scientific and Practical Conference, Sumy, March 22-23, 2021 / edited by Prof., Dr. Vasilyeva Tetyana. – Sumy : Sumy State University, 2021. – pp. 132-135

32. Пластун О.Л., Жужа Л. ESG-звітність та персистентність фінансових даних // Трансформація податкової та обліково-аналітичної систем в контексті сучасних кризових явищ: матеріали Міжнародної науково-практичної конференції, м. Чернівці (Україна, 20 травня 2021 р.). – Чернівці: Технодрук, 2021. – С. 213-216

33. Пластун О.Л. Інерційні та розвороті стратегії після аномальних цінових коливань на ринках нафти на золота // Стратегія і практика інноваційного розвитку фінансового сектору України [Електронний ресурс]: зб. матеріалів IV Міжнар.наук.-практ. конф. (м. Ірпінь, 25-26 березня 2021 р.) / Університет державної фіскальної служби України. – Ірпінь, 2021. – 297-300

34. Пластун О.Л., Рудиченко А. Роль звітності у подоланні інформаційної асиметрії при досягненні компаніями цілей сталого розвитку // Синергетичні драйвери розвитку обліку, податкового аудиту та бізнес-аналітики : збірник тез за матеріалами Міжнародної науково-практичної інтернет-конференції. Ірпінь: Університет ДФС України, 2021. – С. 391-394

35. Пластун О.Л. Дослідження цінових ефектів після аномальних одноденних цінових коливань на фондових ринках // Проблеми та перспективи сучасного розвитку фінансів, обліку та банківської діяльності: IV Міжнародна науково-практична конференція: матеріали конференції, Дніпро, 22 березня 2021 р. [Електронне видання] – Дніпро, Університет імені Альфреда Нобеля, 2021. – С. 165-167

Х. Заключні відомості

Керівник юридичної особи

Васильєв Анатолій Васильович

К. Т. Н.

Перелік осіб-виконавців

Єльнікова Юлія Василівна

(08.00.08)

Артеменко Аліна Сергіївна

Воронцова Анна Сергіївна

(к. е. н., 08.00.08)

Городецька Марина Олександрівна

Джобава Ельдар Георгійович

Жужа Леонід Максимович

Костенко Олена Миколаївна

Кравченко Дмитро Олександрович

Ласукова Анна Сергіївна

(к. е. н.)

Макаренко Інна Олександрівна

(д. е. н., доц.)

Пластун Олексій Леонідович

(д. е. н., професор, 08.00.08)

Рудиченко Артем Григорович

Філатова Ганна Петрівна

Відповідальний за підготовку

Остапова О.П.

облікових документів

Телефон

+38 (054) 268-44-02

Реєстратор

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



Юрченко Тетяна Анатоліївна