

Облікова картка ДіР



I. Загальні відомості

Державний обліковий номер: 0222U005432

Державний реєстраційний номер: 0121U100473

Особливі позначки: відкрита

Дата реєстрації: 30-12-2022

II. Етап виконання ДіР

Номер етапу: 2

Назва етапу: Обґрунтування ключових напрямів соціально-відповідального інвестування на фондовому ринку в Україні.

Початок етапу: 01.2022

Закінчення етапу: 12.2022

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: 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: 2.2 - прикладні дослідження і розробки

Джерела фінансування

7713 - кошти держбюджету

Код програмної класифікації видатків і кредитування (КПКВК): 2201040

Фактичний обсяг фінансування (тис. грн.): 681.406
--

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:

Об'єктом дослідження виступають економічні відносини, що виникають між суб'єктами фондового ринку у процесі відповідального інвестування (BI) як основи для фінансування сталого розвитку. Метою дослідження є розвиток теоретико-методологічних основ та комплексного міждисциплінарного методичного інструментарію до моделювання траєкторії трансформації фондового ринку методами фрактального аналізу та створення в його архітектурі нового сегменту соціально-відповідального інвестування, розробку його інструментарію (продуктів, технологій, інфраструктури), нормативного, інформаційного та регуляторного забезпечення, спрямованих на подолання інвестиційного гепу у досягненні Цілей сталого розвитку. Окрім стандартних методів наукового дослідження, у роботі використовуються методи консолідованого, бібліометричного та SWOT-аналізу, критерії Лапласа, Вальда, Гурвіца і Севіджа, правила Борда і Кондорсе усереднений аналіз, параметричні тести (t-критерії Стюдента та аналіз ANOVA), непараметричні тести (тести Манна-Уїтні), модифікований підхід кумулятивної аномальної віддачі, регресійний аналіз із фіктивними змінними, підхід торгового моделювання. У ході виконання другого етапу реалізації проекту апробовано концептуальні основи здійснення імпакт-інвестицій для постконфліктного відновлення економіки України, проведено ранжування та пріоритизацію проектів для спрямування відповідального інвестування в кліматоохоронні, енергоефективні проекти, проекти циркулярної економіки, оцінено ефективність та резистентність до цінових аномалій традиційних фінансових індексів та індексів зі сталого розвитку як бенчмарків відповідального інвестування, розроблено схему функціонування суверенного фонду добробуту як суб'єкта сегменту соціально-відповідального інвестування на фондовому ринку України

Реферат англійською:

The object of the study is the economic relations that arise between the subjects of the stock market in the process of responsible investment (RI) as a basis for financing sustainable development. The purpose of the research is the development of theoretical and methodological foundations and a complex interdisciplinary methodological toolkit for modeling the trajectory of the transformation of the stock market using fractal analysis methods and the creation of a new segment of socially responsible investment in its architecture, the development of its toolkit (products, technologies, infrastructure), normative, informational and regulatory provision aimed at overcoming the investment gap in achieving the Sustainable Development Goals. In addition to standard methods of scientific research, the work uses methods of consolidated, bibliometric, and SWOT analysis, Laplace, Wald, Hurwitz, and Savage criteria, Bord and Condorcet rules, averaged analysis, parametric tests (Student's t-test and ANOVA analysis), non-parametric tests (tests Mann-Whitney), modified cumulative abnormal return approach, regression analysis with dummy variables, trading modeling approach. During the implementation of the second stage of project implementation, the conceptual foundations of impact investments for the post-conflict recovery of Ukraine's economy were tested, and ranking and prioritization of projects were carried out to direct responsible investment in climate protection, energy-efficient projects, circular economy projects, the effectiveness and resistance to price anomalies of traditional financial indices were evaluated, and indices on sustainable development as benchmarks of responsible investment, a scheme of functioning of the sovereign welfare fund as a subject of the socially responsible investment segment on the stock market of Ukraine was developed

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)

Назва НТП українською: Фрактальна модель трансформації фондового ринку України в контексті соціально-відповідального інвестування

Назва НТП англійською: Fractal model of Ukraine's stock market transformation in the context of socially responsible investing

НТП, яку передбачалося створити:

Причини, через які НТП не було створено:

Отримані результати: Наукові публікації

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

Реєстраційний номер картки технології:

Опис НТП: Проект спрямовано на комплексне та міждисциплінарне вирішення проблеми формування сегменту відповідального інвестування (BI) на фондовому ринку України засобами фрактального моделювання для фінансового забезпечення досягнення цілей сталого розвитку (ЦСР). Базисом для цього виступає комплекс авторських економіко-математичних моделей дослідження впливу обсягів соціально-відповідальних інвестицій на ефективність, ліквідність, волатильність, капіталізацію фондового ринку, оцінювання ефективності моделей соціально-відповідального інвестування, інвестиційної привабливості компаній, галузей, регіонів та країн для соціально-відповідального інвестування, визначення обсягів інвестиційних ресурсів для подолання інвестиційного гепу у досягненні Цілей сталого розвитку з використанням методів фрактального аналізу (метод R/S, SDA, DFA-аналізу, методу фракційного інтегрування, нейронних мереж, лінійного програмування, LOGIT-, PROBIT регресій, VAR, ARIMA та ARMAX моделювання тощо)

Соціально-економічна спрямованість НТП: Авторська ідея, спрямована на вирішення дуалістичного завдання: 1) трансформація фондового ринку України на основі інкорпорації сегменту відповідального інвестування як драйвера підвищення його ефекти

Вплив НТП на довкілля:

Впровадження НТП: Впроваджено

Практична реалізація НТП

Початок етапу: 01.2022

Закінчення етапу: 12.2022

Споживачі продукції: п академічна спільнота СумДУ, п провідні міжнародні ВНЗ та вчені, п учасники фондових ринків та представники бізнесу

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

1. Plastun, A., Bouri, E., Gupta, R., Ji, Q. (2022) Price effects after one-day abnormal returns in developed and emerging markets: ESG versus traditional indices. *North American Journal of Economics and Finance*, 59, № 101572, DOI: 10.1016/j.najef.2021.101572 (Scopus, Q2)
2. Makarenko I., Plastun A., Petrushenko Y., Vorontsova A., Alwasiak S. (2021). SDG 4 and SDG 8 in the knowledge economy: A meta-analysis in the context of post-COVID-19 recovery. *Knowledge and Performance Management*, 5(1), 50-67. doi:10.21511/kpm.05(1).2021.05 (Scopus)
3. Plastun, A., Bouri, E., Havrylina, A., Ji, Q. (2022) Calendar anomalies in passion investments: Price patterns and profit opportunities. *Research in International Business and Finance* Volume 61, <https://doi.org/10.1016/j.ribaf.2022.101678>. (Scopus+WoS, Q1)
4. Caporale, Guglielmo Maria Gil-Alana, Luis Plastun, Alex and Makarenko, Inna, (2022), "Persistence in ESG and conventional stock market indices". *Journal of Economics and Finance*. <https://doi.org/10.1007/s12197-022-09580-0> (Scopus, Q3)
5. Slepecký J., Vorontsova A., Plastun A., Makarenko I., Zhyhlei I. (2022). Net investment position and the stock market: The case of traditional and ESG indices. *Investment Management and Financial Innovations*, 19(2), 51-66. doi:10.21511/imfi.19(2).2022.05 (Scopus, Q3)
6. Makarenko, I., Plastun, A., Kozmenko, S., Kozmenko, O. and Rudychenko, A. (2022) "Corporate Transparency, Sustainable Development and SDG 2 and 12 in Agriculture: The Case of Ukraine", *AGRIS on-line Papers in Economics and Informatics*, Vol. 14, No. , pp.. ISSN 1804-1930. DOI 10.7160/aol.2022.14xxxx. (Scopus, Q2)
7. Caporale, Guglielmo Maria and Plastun, Alex, (2022). Abnormal Returns and Stock Price Movements: Some Evidence from Developed and Emerging Markets *Journal of Investment Strategies*, Vol. 10, No. 4, 29-42 DOI: 10.21314/JOIS.2022.001 (WoS,+Scopus, Q3)
8. Rieznyk O., Treus A., Kozmenko S. Priorities of impact investing in environmental protection projects: the case of the future post-war reconstruction of Ukraine. *Business: Theory and Practice*" (Scopus, Q2)- подано до друку
1. Plastun, Alex, Ludmila Khomutenko, and Serhii Bashlai. 2022. "Is There Any Witching in the Cryptocurrency Market?" *Journal of Risk and Financial Management* 15, no. 2: 92. <https://doi.org/10.3390/jrfm15020092> (WoS)
1. Vorontsova, A., Plastun, A., Filatova, H., Kostenko, E., & Dzhobava, E. (2021). The Reasoning of a Responsible Investment Position in the Structure of the Stock Exchange Market. *European Journal of Management Issues*, 29(4), 232-240. <https://doi.org/10.15421/192122>
2. Ярова І., Журавка Ф., Пластун О., Небаба Н. (2021) Оцінка концентрації ринку туристичних послуг України. *Актуальні проблеми економіки* № 9 (243), 27-37
3. Артеменко, А., Пластун, О., & Михайлов, Д. (2022). Ризик, аналіз, перспективи імпакт-інвестування в постконфліктне відновлення економіки України. *Socio-Economic Relations in the Digital Society*, 2(44), 5-13. <https://doi.org/10.55643/ser.2.44.2022.448>
4. Макаренко І.О., Філатова Г.П., Ласукова А.С., Костенко О.М., Рудиченко А.Г. Концепт функціонування суверенного фонду добробуту як суб'єкта сегменту відповідального інвестування в Україні. *Бізнес-інформ*. 2022. (подано до друку)
5. Yelnikova, Y., Makarenko, I., Artemenko, A., & Gorodetska, M. (2022). Investigation of socially responsible investment strategies taxonomy . *European Journal of Management Issues*, 30(3). Retrieved from <https://mi->

6. Воронцова А. Макаренко І., Єльнікова Ю., Фомінов Р., Пуговкіна Ю. Ранжування та пріоритизація проектів відповідального інвестування у природоохоронній сфері, спрямованих на досягнення ЦСР 13. Вісник Сумського державного університету. Серія Економіка. 2022. №3. С. 113-119. DOI: 10.21272/1817-9215.2022.3-13

1. Пластун О. Л., А. С. Артеменко, І. О. Макаренко. Засади макроекономічного відновлення країн та імпакт-інвестування у постконфліктне відновлення для досягнення стійкого миру (ЦСР 16). Розвиток ринку фінансових послуг в умовах становлення цифрової економіки. Кафедра фінансів, банківської справи та страхування Національного університету «Чернігівська політехніка» (подано до друку)

1. Авторське свідоцтво на науковий твір № 113944 (2022) Пластун О.Л., Макаренко І.О., Воронцова А.С., Єльнікова Ю.В., Петрушенко Ю.В. Методичний підхід до визначення впливу цінових ефектів після одноденних аномальних доходів на ESG та традиційні індекси

2. Авторське свідоцтво на науковий твір № 113524 (2022) Макаренко І.О., Пластун О.Л., Воронцова А.С., Філатова Г.П. Методичні засади моделювання впливу традиційних та ESG індексів на чисту міжнародну інвестиційну позицію

3. Авторське свідоцтво на науковий твір № 114813 (2022) Пластун О.Л., Макаренко І.О., Петрушенко Ю.В., Сухонос В.В., Філатова Г.П. Формалізація взаємозв'язку між обсягами відповідального інвестування та індикаторами (параметрами) фондового ринку

4. Рішення про реєстрацію авторського права на твір № 6555 (2022) Пластун О.Л., Макаренко І.О., Артеменко А.С., Рудиченко А. Г. Барвінок В.Ю., Пуговкіна Ю. А. Концептуальні основи здійснення імпакт-інвестування для постконфліктного відновлення економіки України

Х. Заключні відомості

Керівник юридичної особи

Васильєв Анатолій Васильович

К. Т. Н.

Перелік осіб-виконавців

Єльнікова Юлія Василівна

(к. е. н.)

Артеменко Аліна Сергіївна

Барвінок Вероніка Юріївна

Воронцова Анна Сергіївна

(к. е. н.)

Дужа Таїсія Богданівна

Кушнерьов Олександр Сергійович

Ласукова Анна Сергіївна

(к. е. н.)

Макаренко Інна Олександрівна

(д. е. н.)

Миненко Сергій Володимирович

Пластун Олексій Леонідович

(д. е. н., 08.00.08)

Пуговкіна Юлія Андріївна

Рудиченко Артем Григорович

Треус Алла Анатоліївна

Філатова Ганна Петрівна

(к. е. н.)

Відповідальний за підготовку облікових документів

Сорокоумова О.П.

Телефон

+38 (054) 268-44-02

Реєстратор

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

