

Облікова картка НДДКР

Державний обліковий номер: 0222U004529

Державний реєстраційний номер: 0122U002659

Відкрита

Дата реєстрації: 31-08-2022



1. Етапи виконання

Номер етапу: 1

Назва етапу: Формалізація взаємозв'язків між обсягами відповідального інвестування та ефективністю фінансових ринків України та Австрії

Початок етапу: 05-2022

Закінчення етапу: 08-2022

Вид звітного документа: Проміжний звіт

2. Виконавець

Назва організації: Сумський державний університет

Код ЄДРПОУ/ПН: 05408289

Підпорядкованість: Міністерство освіти і науки України

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

Телефон: 380542334058

E-mail: kanc@sumdu.edu.ua

WWW: <https://www.sumdu.edu.ua/>

3. Власник результатів НДДКР (продукції)

Назва організації: Міністерство освіти і науки України

Код ЄДРПОУ/ПН: 38621185

Адреса: проспект Перемоги, буд. 10, м. Київ, 01135, Україна

Підпорядкованість: Кабінет Міністрів України

Телефон: 380444813221

E-mail: mon@mon.gov.ua

WWW: <https://mon.gov.ua/ua>

Назва організації: Сумський державний університет

Код ЄДРПОУ/ІПН: 05408289

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

Підпорядкованість: Міністерство освіти і науки України

Телефон: 380542334058

E-mail: kanc@sumdu.edu.ua

WWW: <https://www.sumdu.edu.ua/>

4. Джерела та напрями фінансування

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

КПКВК: 2201380

Напрямок фінансування: 2.5 - програми і проекти у сфері міжнародного науково-технічного співробітництва

Джерела фінансування

Джерело фінансування: 7713 - кошти держбюджету

Фактичний обсяг фінансування за звітний етап: 77.300 тис. грн.

5. Науково-технічна робота

Назва роботи (укр)

Трансформація фінансових ринків: відповідальне інвестування та цілі сталого розвитку як елемент покращення системи охорони здоров'я

Назва роботи (англ)

Transformation of the Financial Markets: Responsible Investment and Sustainable Development Goals for a Better Healthcare System

Реферат (укр)

Подолання наслідків пандемії та воєнний стан нівелює прогрес України у досягненні таргетів Цілей сталого розвитку (ЦСР), зокрема ЦСР 3 «Міцне здоров'я та благополуччя». В умовах обмеженості інвестиційних ресурсів, викликаних війною, та необхідності відновлення системи охорони здоров'я актуалізується використання альтернативних інвестиційних інструментів у цій системі, зокрема імпакт-інвестування, а також докорінної перебудови фінансового ринку України з формуванням на ньому сегменту відповідального інвестування. Головна проблема, на яку спрямовано реалізацію проекту, полягає у розробленні моделі функціонування сегменту відповідального інвестування на фінансовому ринку України як основи підвищення ефективності фінансового ринку та акумуляції достатнього обсягу інвестиційних ресурсів для фінансування національної системи ЦСР з урахуванням кращого австрійського досвіду. У ході виконання першого етапу реалізації проекту вперше формалізовано вплив традиційних та ESG індексів (як індикатора що свідчить про динаміку відповідального інвестування) та чистих інвестиційних позицій (як індикатора, що свідчить про ефективність фінансового ринку) України та Австрії у 2005-2021 роках на основі шестикрокового алгоритму. Одержані результати дозволили отримати емпіричні докази на користь гіпотези про важливість фінансового ринку у процесах алокації інвестиційних ресурсів. Було удосконалено методичний підхід до розроблення концептуальних основ імпакт-інвестування як дієвого інструментарію повоєнного відновлення системи охорони здоров'я України та акселерації прогресу за ЦСР 3 з урахуванням австрійського досвіду. Результати проекту можуть бути використані для розробки концептуальних основ імпакт-інвестування в Україні з подальшою їх апробацією на проектах глобального та загальнодержавного значення, у тому числі проектах реформування фінансування національної системи охорони

здоров'я, подолання глобальних ризиків та пандемій з урахуванням австрійського досвіду.

Реферат (англ)

Overcoming the consequences of the pandemic and war is leveling Ukraine's progress in achieving the Sustainable Development Goals (SDGs) targets, in particular, SDG 3, «Good health and well-being». In the conditions of limited investment resources caused by the war and the need to restore the health care system, the use of alternative investment tools in this system, in particular impact investing, as well as the fundamental restructuring of the financial market of Ukraine with the formation of a segment of responsible investment in it, is being actualized. The main problem to which the implementation of the project is aimed is to develop a model of the functioning of the segment of responsible investment in the financial market of Ukraine as a basis for increasing the efficiency of the financial market and accumulating a sufficient amount of investment resources for financing the national system of the Central Bank, taking into account the best Austrian experience. During the first stage of the project, the influence of traditional and ESG indices (as an indicator of the dynamics of responsible investing) and net investment positions (as an indicator of the efficiency of the financial market) of Ukraine and Austria in 2005-2021 was formalized for the first time based on a six-step algorithm. The obtained results made it possible to obtain empirical evidence in favor of the hypothesis about the importance of the financial market in allocating investment resources. The methodological approach to developing the conceptual foundations of impact investing as an effective tool for the post-war recovery of the health care system of Ukraine and the acceleration of progress under SDG 3 was improved, taking into account the Austrian experience. The project results will be applicable to develop fundamental frameworks for impact investing in Ukraine, with further validation of global and national importance projects, including projects aimed to reform the funding of the natio

Індекс УДК: 336.77.067.22; 339.72

Коди тематичних рубрик НТІ: 06.73.35

6. Науково-технічна продукція (НТП)

НТП 1

Назва продукції (укр): Трансформація фінансових ринків: відповідальне інвестування та Цілі сталого розвитку як елемент покращення системи охорони здоров'я

Назва продукції (англ): Transformation of the Financial Markets: Responsible Investment and Sustainable Development Goals for a Better Healthcare System

Очікувані результати: Наукові публікації

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

Опис продукції (укр): В основу проекту покладено гіпотезу, що імплементація моделі відповідального інвестування на фінансовому ринку України через систему новітніх фінансових продуктів, технологій та інструментів регулювання створить не лише фінансове підґрунтя для досягнення ЦСР, але й матиме інтегральний позитивний ефект для перезапуску фінансового ринку України та трансформації його у дієве та стабільне джерело інвестиційних ресурсів. На даному етапі метою дослідження є розроблення концептуальних основ імпакт-інвестування в Україні та визначення трансмісійних механізмів впливу відповідального інвестування на ефективність фондового ринку для постпандемічного та повоєнного відновлення системи охорони здоров'я, активізації прогресу за ЦСР 3 з урахування австрійського досвіду. Результати проекту необхідні для повоєнного відновлення прогресу України у досягненні ЦСР 3, оптимізації використання інвестиційних ресурсів у сфері охорони здоров'я на основі механізму імпакт-інвестування в Україні з подальшою апробацією на проектах реформування фінансування національної системи охорони здоров'я, подолання глобальних ризиків та пандемій.

Соціально-економічна спрямованість НТП: Поліпшення якості життя та здоров'я населення, ефективності діагностики та лікування хворих

Стадія завершеності НТП: Ідея, концепція

Впровадження НТП: Впроваджено

Строки впровадження: 05.2022-08.2022

Виробник продукції: СумДУ

Споживачі продукції: академічна спільнота СумДУ та Університету Куфштайн, органи державної влади (фінансові регулятори, органи охорони здоров'я), громадськість

Перспективні ринки: Національна система охорони здоров'я України та Австрії

Права інтелектуальної власності: В Україні, За кордоном

Форми та умови передачі продукції: Спільні НДДКР

7. Бібліографічний опис

1. Alex Plastun, Inna Makarenko, Daniel Salabura, Yulia Serpeninova and Mario Situm (2022). Forecasting the net investment position based on conventional and ESG stock market indices: The case of Ukraine and Austria. Investment Management and Financial Innovations, 19(3), 60-71. doi:10.21511/imfi.19(3).2022.06 (Scopus)

2. Serpeninova Yuliia and Milos Tumpach (2022) Sustainability reporting trends. Mezinárodní vědecká konference Účetnictví a auditing v procesu světové harmonizace, Lednice, 6.9.-8.9.2022 (forthcoming, indexing in WoS expected)

8. Звітна документація

Кількість сторінок в звіті: 76

Мова звіту: Українська

Умови поширення в Україні: Не заборонено

Умови передачі іншим країнам: Не заборонено

Кількість файлів у звіті: 1

9. Заключні відомості

Перелік осіб-виконавців

Макаренко Інна Олександрівна (д. е. н., професор)

Пластун Олексій Леонідович (д. е. н., професор)

Серпенінова Юлія Сергіївна (к. е. н., доц.)

Філатова Ганна Петрівна (к. е. н.)

Керівник організації:

Карпуша Василь Данилович (к. ф.-м. н., доц.)

Керівники роботи:

Пластун Олексій Леонідович (д. е. н., професор)

**Керівник відділу реєстрації наукової діяльності
УкрІНТЕІ**



Юрченко Т.А.