



Provozně
ekonomická
fakulta

8. 9. 2017, Bedřichov

prof. RNDr. Jiří Hřebíček, CSc.
doc. Ing. Oldřich Trenz, Ph.D.
Ing. Oldřich Faldík, Ph.D.

Stav řešení projektu GAČR

Modelování a simulace udržitelného
investování pro podporu rozhodování

Mendelova
univerzita
v Brně



GAČR

GRANTOVÁ AGENTURA ČESKÉ REPUBLIKY

Popis projektu



- Projekt řešen 2017–2019
- Řešitelská pracoviště
 - FP VUT, prof. Ing. Alena Kocmanová, Ph.D.
 - PEF MENDELU, prof. RNDr. Jiří Hřebíček, CSc.
- Projekt volně navazuje na předchozí projekty (GAČR) **Měření podnikové udržitelnosti ve vybraných odvětvích a Konstrukce metod pro vícefaktorové měření komplexní podnikové výkonnosti ve vybraném odvětví**

Průběh řešení projektu

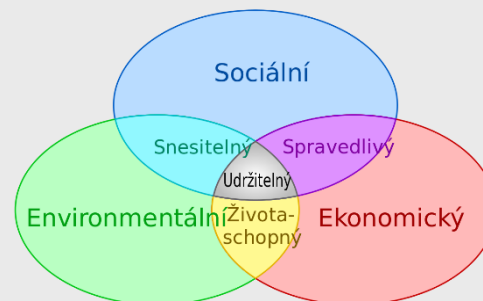
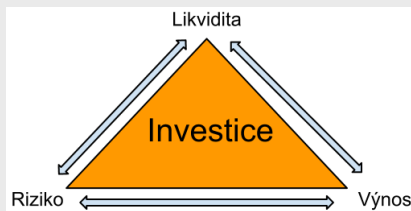
- Výzkum v oblasti udržitelného investování na finančních trzích:
 - Individuální investování
 - Kolektivní investování
- Společensky odpovědné investování jako podmnožina udržitelného investování (riziko, likvidita, výnosnost)
- Začlenění aspektů environmentální, sociální a Corporate governance (ESG) vlivů na výsledný model

Průběh řešení projektu

- 1. rok
 - Analýza současného stavu udržitelného investování v ČR, dostupné modely hodnocení, metody investičního rozhodování, metod vyhodnocení investičních rizik
 - Analýza zpráv o fondech SRI (Socially Responsible Investment), porovnání výkonnosti investic za pomoci DEA přístupu (Data Envelopment Analysis)
 - Identifikace klíčových faktorů ESG pro udržitelné investování
- 2. rok
 - Návrh modelu udržitelného investování pro vybrané odvětví (vodní hospodářství, odpady, obnovitelné energie, IT, potravinářský segment)
- 3. rok
 - Návrh metodiky pro investory, implementace softwaru pro podporu udržitelného investování

Průběh řešení projektu

- Cílem projektu je navrhnout, implementovat a ověřit model a metodiku udržitelného investování zohledňující ESG faktory



Aktuální publikace (2017)

- **FKP 2017**, Selected aspect to determine of sustainable value added in enterprise
- **Sardinie symposium 2017**, Sustainable investment in management – A case study on LDPE plastics
- **Acta MENDELU, 2017**, Sustainability assesment and reporting in agriculture sector

Výstupy

- Identifikace klíčových ESG indikátorů pro udržitelné investování
- Navržení modelu pro udržitelné investování
- Implementace softwaru integrující v sobě sestavený přístup
- Sběr dat z kolektivního a individuálního investování (fondy, společnosti, a jiné investice) z vybraného tržního segmentu
- Publikační výstupy