NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC
VIỆT NAM
VIỆN CHIẾN LƯỢC NGÂN HÀNG

Số: 440/QĐ-VCL

CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Hà Nội, ngày ...9.. tháng ..5.. năm 2019

QUYẾT ĐỊNH
Về việc phê duyệt Danh mục nhiệm vụ Khoa học và Công nghệ đặt hàng cấp cơ sở năm 2019 của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam

VIỆN TRƯỞNG VIỆN CHIẾN LƯỢC NGÂN HÀNG

Căn cứ Luật Khoa học và Công nghệ số 29/2013/QH13 ngày 18/6/2013;

Căn cứ Nghị định số 08/2014/NĐ-CP ngày 27/01/2014 của Chính phủ quy định chi tiết thi hành một số điều của Luật Khoa học và Công nghệ;

Căn cứ Nghị định số 16/2017/NĐ-CP ngày 17 tháng 02 năm 2017 của Chính phủ quy định chức năng, nhiệm vụ, quyền hạn và cơ cấu tổ chức của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam;

Căn cứ Thông tư số 37/2015/TT-NHNN ngày 31 tháng 12 năm 2015 quy định về quản lý và tổ chức thực hiện các nhiệm vụ khoa học và công nghệ có sử dụng ngân sách nhà nước thuộc trách nhiệm quản lý của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam;

Căn cứ Kế hoạch số 06/KH-NHNN ngày 29/6/2018 của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam về Kế hoạch và dự toán ngân sách khoa học và Công nghệ ngành ngân hàng năm 2019;

Căn cứ Biên bản Hội đồng tư vấn xác định nhiệm vụ KH&CN cấp cơ sở năm 2019 của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam;

Theo đề nghị của Trưởng phòng Phòng Quản lý khoa học và công nghệ ngân hàng,

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Phê duyệt Danh mục nhiệm vụ Khoa học và Công nghệ đặt hàng cấp cơ sở năm 2019 của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam.

(Danh mục đính kèm)

Điều 2. Quyết định này có hiệu lực thi hành kể từ ngày ký.

Điều 3. Trưởng phòng Phòng Quản lý khoa học và công nghệ ngân hàng, các tổ chức và cá nhân liên quan có trách nhiệm thi hành Quyết định này./.

Nơi nhận:
- Như điều 3;
- Lưu VP, VCL4 (05 bản).

Đính kèm:
- Danh mục nhiệm vụ KH&CN đặt hàng cấp cơ sở năm 2019 của NHNN Việt Nam.

KT. VIỆN TRƯỞNG
PHÓ VIỆN TRƯỞNG

NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC VIỆT NAM
VIỆN CHIẾN LƯỢC NGÂN HÀNG

Nguyễn Thị Hòa

NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC VIỆT NAM
VIỆN CHIẾN LƯỢC NGÂN HÀNG

CỘNG HOÀ XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM
Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Hà Nội, ngày 9 tháng 5 năm 2019

DANH MỤC NHIỆM VỤ KHOA HỌC VÀ CÔNG NGHỆ ĐẶT HÀNG CẤP CƠ SỞ NĂM 2019 CỦA NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC VIỆT NAM

(Đính kèm Quyết định số 440/QĐ-VCL ngày 9.../...5. /2019 của Viện trưởng Viện Chiến lược ngân hàng)

STT	Tên đề tài/dự án	Mã số	Đơn vị/ cá nhân đề xuất	Định hướng mục tiêu, nội dung nghiên cứu và yêu cầu về kết quả nghiên cứu
1	Giải pháp nâng cao hiệu quả công tác thanh tra, kiểm tra hoạt động thanh toán đối với các tổ chức tín dụng	ĐTNH-CS.001/19	ThS. Đỗ Thị Nhàn, Vụ trưởng Vụ thanh tra, giám sát các TCTD trong nước, Cơ quan Thanh tra, giám sát ngân hàng, NHNN	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Nghiên cứu nhằm đề xuất giải pháp nâng cao hiệu quả công tác thanh tra, kiểm tra hoạt động thanh toán và cung ứng dịch vụ thanh toán của các TCTD, đề xuất hoàn thiện khuôn khổ pháp lý nhằm đảm bảo hoạt động thanh toán quốc gia an toàn, ổn định ***Nội dung nghiên cứu:*** - Lý luận về hoạt động thanh toán, các dịch vụ thanh toán do các tổ chức tín dụng (TCTD) cung cấp và các rủi ro liên quan. Rà soát khuôn khổ pháp lý liên quan. - Đánh giá tổng quan hoạt động thanh toán và cung ứng dịch vụ thanh toán của các TCTD và công tác thanh tra, kiểm tra lĩnh vực thanh toán đối với các TCTD. - Đề xuất giải pháp nâng cao hiệu quả công tác thanh tra, kiểm tra hoạt động thanh toán và cung ứng dịch vụ thanh toán của các TCTD (trong đó đưa ra được phương pháp, hướng dẫn cơ bản trong công tác thanh tra, kiểm tra hoạt động thanh toán, các dịch vụ thanh toán do các TCTD cung cấp), đề xuất hoàn hiện khuôn khổ pháp lý nhằm đảm bảo hoạt động thanh toán quốc gia an toàn, ổn định. ***Yêu cầu về kết quả nghiên cứu:*** Nội dung nghiên cứu cần đưa ra được phương pháp, hướng dẫn cơ bản trong công tác thanh tra, kiểm tra hoạt động thanh toán, các dịch vụ thanh toán do các TCTD cung cấp.

2	Xây dựng mô hình Copula COVAR trong cảnh báo sớm đối với các ngân hàng thương mại Việt Nam	ĐTNH-CS.002/19	TS. Tạ Quốc Bảo, Bộ môn Toán Kinh tế, ĐHNH TP.HCM	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Nghiên cứu áp dụng mô hình Copula CoVaR trong cảnh báo sớm đối với các ngân hàng thương mại (NHTM) Việt Nam. ***Nội dung nghiên cứu:*** - Hệ thống lại toàn bộ các mô hình toán học và các phương pháp đo lường rủi ro hệ thống tài chính trong và ngoài nước cho đến nay, từ đó xây dựng mô hình đo lường rủi ro hệ thống cho thị trường Việt Nam. - Xác định được họ Copula (Copula families) của hệ thống ngân hàng, dựa vào đó xác định giá trị CoVaR và cấu trúc phụ thuộc của các NHTM. - Sử dụng ngôn ngữ R để xây dựng bộ chương trình tính toán giá trị CoVaR và cấu trúc phụ thuộc dựa trên các dữ liệu của hệ thống NHTM Việt Nam. ***Yêu cầu về phương thức triển khai thực hiện:*** - Để tránh trùng lắp với các nghiên cứu đã có, cần có phần đánh giá tổng quan đầy đủ các nghiên cứu trong và ngoài nước (đặc biệt là Đề tài ĐTNH-CS.001/17 "Một số giải pháp nhằm hoàn thiện khuôn khổ pháp lý đối với công tác giám sát ngân hàng") để làm rõ khoảng trống nghiên cứu, giá trị gia tăng của nghiên cứu. - Bổ sung các chỉ tiêu phân tích để đảm bảo mô hình nghiên cứu phản ánh rõ hơn mức độ rủi ro của NHTM.
3	Xác định chu kỳ tài chính: Kinh nghiệm quốc tế và đề xuất cho Việt Nam	ĐTNH-CS.003/19	Vụ Ổn định tiền tệ-tài chính, NHNN	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Nghiên cứu về chu kỳ tài chính (CKTC) và phương pháp luận để xác định CKTC. Qua đó, đề xuất phương pháp xác định CKTC cho Việt Nam. ***Nội dung nghiên cứu:*** - Tổng quan về chu kỳ tài chính: khái niệm; đặc điểm; các nhân tố tác động và yếu tố nhận biết chu kỳ tài chính; phương pháp đo lường chu kỳ tài chính. - Kinh nghiệm quốc tế về chu kỳ tài chính và phương pháp xác định chu kỳ tài chính tại các nước trên thế giới – rút ra bài học cho Việt Nam. - Xác định chu kỳ tài chính tại Việt Nam (đề xuất phương pháp và kết quả đầu ra).
4	Quy trình thực thi các công cụ chính sách an	ĐTNH-CS.004/19	Vụ Ổn định tiền tệ-tài chính,	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Đề xuất quy trình thực thi chính sách an toàn vĩ mô, bao gồm việc nhận diện rủi ro hệ

	toàn vĩ mô tại Việt Nam		NHNN	thống, lựa chọn, áp dụng các công cụ chính sách an toàn vĩ mô ***Nội dung nghiên cứu:*** - Cơ sở lý luận về quy trình thực thi chính sách an toàn vĩ mô (hệ thống chỉ số, chỉ báo để lựa chọn, kích hoạt hay thoái lui các công cụ chính sách an toàn vĩ mô; mức độ sử dụng...) - Kinh nghiệm quốc tế trong việc xây dựng quy trình thực thi chính sách an toàn vĩ mô và bài học kinh nghiệm cho Việt Nam. - Đề xuất quy trình thực thi chính sách an toàn vĩ mô, bao gồm việc xác định mục tiêu, cách thức lựa chọn công cụ và mức độ áp dụng các công cụ chính sách an toàn vĩ mô; công tác truyền thông trong thực thi chính sách an toàn vĩ mô.
5	Xây dựng phương pháp tự đánh giá quản trị ngân hàng thương mại	ĐTNH-CS.005/19	Vụ Ổn định tiền tệ-tài chính, NHNN	***Mục tiêu nghiên cứu:*** - Xây dựng quy trình, phương pháp tự đánh giá thực tiễn quản trị ngân hàng thương mại (NHTM) theo các chuẩn mực, nguyên tắc quốc tế được thừa nhận rộng rãi để phục vụ công tác đánh giá định kỳ của NHNN. - Xác định khoảng cách giữa thực tiễn quản trị NHTM tại Việt Nam hiện nay với nguyên tắc, thông lệ quốc tế; từ đó khuyến nghị các quy định, chính sách liên quan. ***Nội dung nghiên cứu:*** - Nghiên cứu, hệ thống hóa các vấn đề lý luận, nguyên tắc, chuẩn mực quốc tế về quản trị NHTM. - Xây dựng hệ thống hướng dẫn đánh giá chi tiết về thực tiễn quản trị NHTM theo các nguyên tắc và thông lệ quốc tế gồm hệ thống các nguyên tắc quản trị NHTM (tích hợp các bộ chuẩn mực, nguyên tắc, khuyến nghị của các tổ chức quốc tế và nhà nghiên cứu), xây dựng bảng khảo sát, bảng hỏi và phương pháp phỏng vấn thực tế để đánh giá thực tiễn ngân hàng. - Lựa chọn một số NHTM trong 10 NHTM thí điểm áp dụng Basel II để đánh giá. - Đề xuất cơ chế/quy trình triển khai đánh giá cập nhật định kỳ về quản trị ngân hàng và cơ chế thực thi các khuyến nghị.
6	Giải pháp cải thiện vai trò của Hiệp hội Quỹ tín dụng nhân dân Việt	ĐTNH-CS.006/19	TS. Nguyễn Thị Kim Thanh,	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Đưa ra hệ thống giải pháp và lộ trình thực hiện nhằm cải thiện vai trò của Hiệp hội

	Nam		Phó Tổng thư ký Hiệp hội Quỹ tín dụng nhân dân	Quỹ tín dụng nhân dân (QTDND) Việt Nam trong việc làm cầu nối giữa hội viên với các cơ quan quản lý nhà nước, kết nối giữa các hội viên, hỗ trợ tư vấn, đào tạo và quảng bá hình ảnh cho các hội viên, góp phần thực hiện có hiệu quả Đề án củng cố và phát triển QTDND đến 2020 và định hướng đến 2030. ***Nội dung nghiên cứu:*** - Đánh giá thực trạng hoạt động của Hiệp hội QTDND trong việc thực hiện các nhiệm vụ của mình. Làm rõ vai trò của Hiệp hội QTDND đối với: (i) Cơ quan quản lý; (ii) các hội viên; (iii) đối với xã hội. - Đánh giá thực trạng hoạt động của hệ thống QTDND, tập trung phân tích làm rõ tính liên kết hệ thống, năng lực hoạt động, tính tuân thủ tôn chỉ mục đích của các hội viên, từ đó làm rõ nhu cầu hỗ trợ, xác định rõ vai trò và trách nhiệm của Hiệp hội QTDND trong việc hỗ trợ quá trình hoạt động của các QTDND hội viên. - Xây dựng định hướng, giải pháp và lộ trình nhằm cải thiện vai trò của Hiệp hội QTDND. ***Yêu cầu về kết quả nghiên cứu:*** Kết quả nghiên cứu cần làm rõ các nguyên nhân làm giảm hiệu quả vai trò của Hiệp hội QTDND trong việc làm cầu nối giữa hội viên với các cơ quan quản lý nhà nước, kết nối giữa các hội viên (từ năng lực hoạt động, khả năng truyền dẫn hay các vấn đề khác).
7	Ứng dụng mô hình kết hợp các chỉ tiêu với tần suất khác nhau (Nowcasting) trong phân tích và dự báo tăng trưởng GDP	DANH-CS.001/19	ThS. Đặng Ngọc Hà, Trưởng phòng, Vụ Dự báo thống kê, NHNN	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Xây dựng và phát triển mô hình kết hợp các chỉ tiêu với tần suất khác nhau (Nowcasting) trong phân tích và dự báo tăng trưởng GDP ***Nội dung nghiên cứu:*** - Tổng quan về các mô hình Nowcasting: cơ sở lý thuyết và kinh nghiệm phát triển, ứng dụng mô hình Nowcasting tại các NHTW trên thế giới; - Cấu trúc hoạt động của các mô hình Nowcasting: chi tiết về kỹ thuật định lượng, cấu trúc vận hành của từng mô hình Nowcasting trong phân tích và dự báo các chỉ tiêu kinh tế vĩ mô; - Xây dựng mô hình Nowcasting ứng dụng tại NHNN; - Các khuyến nghị nhằm nâng cao khả năng ứng dụng mô hình Nowcasting tại NHNN.

				Yêu cầu về phương thức triển khai thực hiện: Thuyết minh cần làm rõ cấu trúc và phương pháp luận của mô hình Nowcassting; Phương pháp thu thập số liệu để chạy mô hình
8	Xây dựng hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm rủi ro tiềm ẩn trong hoạt động giám sát của Ngân hàng Nhà nước đối với các tổ chức tín dụng, chi nhánh ngân hàng nước ngoài	DANH-CS.002/19	TS. Nguyễn Phi Lân, Vụ trưởng, Vụ Giám sát an toàn hệ thống ngân hàng, Cơ quan Thanh tra giám sát ngân hàng, NHNN	***Mục tiêu nghiên cứu:*** - Xây dựng và phát triển kho dữ liệu về hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. - Xây dựng và hoàn thiện các ngưỡng cảnh báo liên quan đến hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. - Xây dựng Sổ tay hướng dẫn sử dụng hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. ***Nội dung nghiên cứu:*** - Xây dựng và phát triển hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm, có khả năng phát hiện các dấu hiệu phản ánh sự suy giảm về tình hình tài chính, những biến động bất thường trong hoạt động của TCTD, chi nhánh ngân hàng nước ngoài. - Xây dựng và phát triển kho dữ liệu về hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. - Xây dựng và hoàn thiện các ngưỡng cảnh báo liên quan đến hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. - Xây dựng và phát triển các ứng dụng để hỗ trợ việc triển khai hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm tại Cơ quan Thanh tra, giám sát ngân hàng. - Xây dựng Sổ tay hướng dẫn sử dụng hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. ***Yêu cầu về phương thức triển khai thực hiện:*** Để tránh trùng lắp trong nghiên cứu, khi triển khai xây dựng thuyết minh và nghiên cứu, cần: - Đánh giá tổng quan các nghiên cứu trong và ngoài nước liên quan, tập trung vào phát triển kho dữ liệu về hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm, xây dựng và hoàn thiện các ngưỡng cảnh báo liên quan đến hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm, xây dựng Sổ tay hướng dẫn sử dụng hệ thống chỉ tiêu cảnh báo sớm. - Làm rõ phương pháp triển khai thực hiện.
9	Ứng dụng công nghệ thông tin vào hoạt động nghiệp vụ lưu ký giấy tờ	DANH-CS.003/19	ThS. Nguyễn Thị Phương Mai, Phó Giám	***Mục tiêu nghiên cứu:*** Tìm hiểu hiện trạng và khả năng ứng dụng công nghệ (chứng từ điện tử) vào loại hình sản phẩm liên quan đến hoạt động lưu ký giấy tờ có giá (GTCG) mà NHNN đang cung

	có giá tại Ngân hàng Nhà nước		đốc Sở Giao dịch, NHNN	cấp cho khách hàng nhằm hạn chế các rủi ro do khâu tác nghiệp trung gian có thể mắc phải trong các giao dịch lưu ký GTCG giữa NHNN và khách hàng. ***Nội dung nghiên cứu:*** - Hiện trạng quản lý nghiệp vụ lưu ký GTCG tại NHNN, gồm: (i) Hệ thống pháp lý quy định về lưu ký GTCG tại NHNN; (ii) Hiện trạng quản lý nghiệp vụ lưu ký GTCG tại NHNN; (iii) Định hướng quản lý nghiệp vụ và khả năng ứng dụng công nghệ vào hoạt động lưu ký GTCG tại NHNN, nhận dạng các rủi ro khi ứng dụng công nghệ. - Giải pháp ứng dụng công nghệ vào hoạt động nghiệp vụ lưu ký GTCT tại NHNN, gồm: (i) Đề xuất về cơ sở pháp lý; (ii) Đề xuất giải pháp hạn chế/kiểm soát rủi ro khi ứng dụng công nghệ thông tin vào hoạt động nghiệp vụ lưu ký GTCG tại NHNN; (iii) Đề xuất quy trình nghiệp vụ ứng dụng công nghệ vào hoạt động lưu ký GTCG tại NHNN; (iv) Đề xuất nâng cấp hệ thống phần mềm hiện có. ***Yêu cầu về phương thức triển khai thực hiện:*** - Khi xây dựng Thuyết minh và triển khai nghiên cứu, cần làm rõ hơn nội hàm của việc ứng dụng công nghệ thông tin (cụ thể là công nghệ gì, đã có hay chưa có), loại GTCG áp dụng.

VIỆN TRƯỞNG

PHÓ VIỆN TRƯỞNG

NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC VIỆT NAM
VIỆN CHIẾN LƯỢC NGÂN HÀNG

Nguyễn Thị Hòa