

NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC
VIỆT NAM

Số: *1211* /QĐ-NHNN

CỘNG HÒA XÃ HỘI CHỦ NGHĨA VIỆT NAM

Độc lập - Tự do - Hạnh phúc

Hà Nội, ngày 22 tháng 6 năm 2023

QUYẾT ĐỊNH

Về việc phê duyệt Danh mục nhiệm vụ khoa học và công nghệ đặt hàng cấp Bộ năm 2023 (đợt 3) của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam đối với đề xuất từ Học viện Ngân hàng

THÔNG ĐỐC NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC

Căn cứ Luật khoa học và công nghệ 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 102/2022/NĐ-CP ngày 12 tháng 12 năm 2022 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 biên bản họp Hội đồng 7 và Hội đồng 8 - Hội đồng tư vấn xác định nhiệm vụ khoa học và công nghệ năm 2023 của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam;

Theo đề nghị của Viện trưởng Viện Chiến lược ngân hàng,

QUYẾT ĐỊNH:

Điều 1. Phê duyệt Danh mục nhiệm vụ khoa học và công nghệ đặt hàng cấp Bộ năm 2023 (đợt 3) của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam đối với đề xuất từ Học viện Ngân hàng (*Phụ lục đính kèm*).

Điều 2. Viện Chiến lược ngân hàng có trách nhiệm tổ chức triển khai các nhiệm vụ trong Danh mục nhiệm vụ khoa học và công nghệ đặt hàng cấp Bộ năm 2023 (đợt 3) của Ngân hàng Nhà nước Việt Nam đối với đề xuất từ Học viện Ngân hàng theo quy định hiện hành.

Điều 3. Quyết định này có hiệu lực thi hành kể từ ngày ký.

Điều 4. Chủ tịch Hội đồng khoa học và công nghệ ngành Ngân hàng; Viện trưởng Viện Chiến lược ngân hàng và Giám đốc Học viện Ngân hàng chịu trách nhiệm thi hành Quyết định này. ✓

Nơi nhận:

- Như điều 4;
- Thống đốc NHNN (để b/c);
- Phó Thống đốc Phạm Thanh Hà;
- Lưu VP, VCL4.NTHau (15). ✓

Đính kèm:

- Phụ lục Quyết định.

**KT.THỐNG ĐỐC
PHÓ THỐNG ĐỐC**



Phạm Thanh Hà

PHỤ LỤC
DANH MỤC NHIỆM VỤ KHOA HỌC VÀ CÔNG NGHỆ ĐẶT HÀNG CẤP BỘ NĂM 2023 (ĐỢT 3)
CỦA NGÂN HÀNG NHÀ NƯỚC VIỆT NAM ĐỐI VỚI ĐỀ XUẤT TỪ HỌC VIỆN NGÂN HÀNG
(Đính kèm Quyết định số 1211/QĐ-NHNN ngày 22 tháng 6 năm 2023 của Thống đốc NHNN)

STT	Tên đề tài/dự án	Mã số	Đơn vị/cá nhân đề xuất	Định hướng mục tiêu, nội dung nghiên cứu, yêu cầu đối với kết quả nghiên cứu và phương thức tổ chức thực hiện
1	Đánh giá tác động của rủi ro quốc gia (country risk) đến dòng vốn FDI tại Việt Nam.	ĐTNH.010/23	PGS. TS. Trần Thị Xuân Anh, Trưởng Khoa Tài chính, Học viện Ngân hàng	Mục tiêu nghiên cứu: - Nghiên cứu những vấn đề cơ bản về rủi ro quốc gia - Nghiên cứu khung lý luận tác động của rủi ro quốc gia đến FDI - Nghiên cứu thực nghiệm tác động của rủi ro quốc gia đến FDI tại Việt Nam và các nước ASEAN. - Khuyến nghị chính sách cho Việt Nam đến 2030. Nội dung nghiên cứu: - Tổng quan về tác động của rủi ro quốc gia đến dòng vốn FDI - Những vấn đề cơ bản về rủi ro quốc gia - Khung lý luận đánh giá tác động của rủi ro quốc gia đến dòng vốn FDI - Các bằng chứng thực nghiệm - Đánh giá tác động của rủi ro quốc gia đến dòng vốn FDI tại Việt Nam và các nước ASEAN - Rủi ro quốc gia của Việt Nam và các nước ASEAN - Mô hình nghiên cứu định lượng - Dữ liệu và phương pháp nghiên cứu - Kết quả nghiên cứu đánh giá tác động của rủi ro quốc gia đến dòng vốn FDI tại Việt Nam và các nước ASEAN - Khuyến nghị chính sách cho Việt Nam đến 2030.

				<i>Yêu cầu đối với kết quả nghiên cứu:</i> + Làm rõ lý do thu thập số liệu của công ty PRS mà không phải là số liệu của các công ty xếp hạng tín nhiệm như Fitch, Moody's hay S&P. Sự khác biệt về phương pháp luận của nhóm nghiên cứu so với các công ty xếp hạng tín nhiệm Fitch, Moody's và S&P. + Nhóm nghiên cứu cần đề xuất các chỉ số rủi ro quốc gia có liên quan chặt chẽ đối với FDI vào Việt Nam (các chỉ số này cần đáp ứng được mối quan tâm của các nhà đầu tư nước ngoài), từ đó đề xuất cụ thể với Chính phủ và các bộ, ngành.
2	Hoàn thiện pháp luật về quản trị công ty đối với ngân hàng thương mại ở Việt Nam theo thông lệ quốc tế.	ĐTNH.011/23	TS. Phan Đăng Hải, Khoa Luật, Học viện Ngân hàng	<i>Mục tiêu nghiên cứu:</i> Tập trung đánh giá, làm rõ các kênh tác động và mức độ tác động của chính sách tiền tệ - chính sách tài khóa (CSTT - CSTK) của Mỹ, EU và Trung Quốc đến điều kiện tiền tệ của Việt Nam, trên cơ sở đó đưa ra những khuyến nghị chính sách. <i>Nội dung nghiên cứu:</i> 1. Tổng quan nghiên cứu - Tổng quan các nghiên cứu quốc tế về quản trị công ty đối với NHTM và việc nội luật hóa các nguyên tắc, thông lệ quốc tế tốt về quản trị công ty đối với NHTM. - Tổng quan các nghiên cứu trong nước về quản trị công ty đối với NHTM và vấn đề hoàn thiện pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM. - Rút ra các kết luận về những vấn đề tiếp thu và khoảng trống nghiên cứu. 2. Cơ sở lý luận liên quan đến pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM - Khái niệm, đặc trưng, vai trò của quản trị công ty đối với NHTM. - Khung pháp luật và nội dung pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM. - Các yếu tố ảnh hưởng đến pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM. 3. Các thông lệ quốc tế, kinh nghiệm xây dựng pháp luật về vấn đề quản trị

			công ty đối với NHTM trên thế giới - Thông lệ quốc tế về quản trị công ty đối với NHTM. - Hoạt động xây dựng và hoàn thiện pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM tại một số quốc gia. - Bài học kinh nghiệm đối với Việt Nam. 4. Thực trạng pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam - Phân tích thực trạng quy định pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam hiện nay trên cơ sở so sánh với các thông lệ quốc tế và yếu tố tương thích của các văn bản trong hệ thống pháp luật Việt Nam. - Đánh giá thực tiễn thi hành pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam hiện nay. Nhận diện các nguyên nhân của những bất cập tồn tại. 5. Nghiên cứu hoàn thiện pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam trên cơ sở tiếp nhận các thông lệ quốc tế. - Phương hướng hoàn thiện pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam. - Giải pháp hoàn thiện nội dung pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam. - Giải pháp nâng cao hiệu quả thi hành pháp luật về quản trị công ty đối với NHTM ở Việt Nam. <i>Yêu cầu đối với kết quả nghiên cứu:</i> - Đề tài cần bổ sung nghiên cứu của IFC và WB, đánh giá về hoạt động quản trị và đối chiếu với các quy định của pháp luật để làm rõ khoảng trống nghiên cứu. - Cần bổ sung phương pháp phỏng vấn sâu khi triển khai thực hiện đề tài. - Cần đánh giá vai trò của NHNN đối với quản trị công ty như thế nào? Thể hiện ở đâu?
--	--	--	--

3	Thực trạng và giải pháp quản trị hoạt động đầu tư và cung ứng dịch vụ trái phiếu doanh nghiệp tại các NHTM Việt Nam.	ĐTNH.012/23	GS. TS. Nguyễn Văn Tiền, Học viện Ngân hàng	Mục tiêu nghiên cứu: - Làm rõ cơ sở lý luận mối quan hệ giữa sự phát triển thị trường trái phiếu và hoạt động của các NHTM trên các khía cạnh hiệu quả và rủi ro. - Đánh giá thực trạng thị trường trái phiếu doanh nghiệp, các quy định điều tiết hoạt động đầu tư trực tiếp và (gián tiếp cho doanh nghiệp vay vốn) đầu tư vào trái phiếu doanh nghiệp tại các NHTM, mức độ hiệu quả về tài chính và rủi ro đi kèm đối với hoạt động đầu tư trái phiếu doanh nghiệp của các NHTM. - Đề xuất kiến nghị, giải pháp đối với các NHTM để nâng cao hiệu quả hoạt động đầu tư và cung ứng dịch vụ trái phiếu; với Ngân hàng Nhà nước, Bộ Tài chính (Ủy ban Chứng khoán nhà nước), Chính phủ để nâng cao hiệu quả quản lý hoạt động đầu tư trái phiếu doanh nghiệp tại các NHTM. Nội dung nghiên cứu: 1. Phân tích cơ sở lý luận về mục đích, lợi ích và rủi ro của hoạt động đầu tư trái phiếu doanh nghiệp của các NHTM; cơ chế ảnh hưởng của sự biến động thị trường trái phiếu doanh nghiệp tới hiệu quả và an toàn của NHTM nói riêng và hệ thống ngân hàng nói chung. 2. Phân tích thực trạng đầu tư vào trái phiếu doanh nghiệp của các NHTM; đánh giá tác động của hoạt động đầu tư trái phiếu doanh nghiệp tới hiệu quả và rủi ro của hệ thống ngân hàng. 3. Phân tích hoạt động phân phối trái phiếu doanh nghiệp của các NHTM bao gồm các nội dung chính sách, quy trình triển khai, kết quả, lợi ích và rủi ro của hoạt động phân phối trái phiếu; Làm rõ vai trò, quyền và nghĩa vụ của NHTM trong hoạt động tư vấn khách hàng đầu tư trái phiếu doanh nghiệp; Tách bạch hoạt động tư vấn đầu tư của NHTM với hoạt động tư vấn của cán bộ ngân hàng với tư cách là cá nhân. 4. Đề xuất kiến nghị, giải pháp đối với các NHTM để nâng cao hiệu quả hoạt động đầu tư và cung ứng dịch vụ trái phiếu; với NHNN, Bộ Tài chính (Ủy
---	--	-------------	---	--

				ban Chứng khoán nhà nước), Chính phủ để nâng cao hiệu quả quản lý hoạt động đầu tư trái phiếu doanh nghiệp tại các NHTM. <i>Yêu cầu đối với kết quả nghiên cứu:</i> - Đề tài cần đánh giá khung pháp lý và tình hình thực thi hoạt động đầu tư và cung ứng dịch vụ trái phiếu doanh nghiệp. - Đề tài cần đưa ra đề xuất, kiến nghị đối với NHNN, Bộ Tài chính (Ủy ban Chứng khoán nhà nước), Chính phủ và các bộ/ngành khác (nếu có) để nâng cao hiệu quả quản lý hoạt động đầu tư trái phiếu doanh nghiệp tại các NHTM.
4	Kinh nghiệm quốc tế và khả năng áp dụng quy trình đánh giá đầy đủ về thanh khoản tại các NHTM Việt Nam.	ĐTNH.013/23	TS. Nguyễn Thu Trang, Khoa Ngân hàng, Học viện Ngân hàng	<i>Mục tiêu nghiên cứu:</i> Nghiên cứu kinh nghiệm quốc tế và khả năng áp dụng quy trình đánh giá nội bộ về mức đủ thanh khoản tại các ngân hàng thương mại Việt Nam. <i>Nội dung nghiên cứu:</i> 1. Hệ thống hóa và làm rõ vấn đề lý luận về quy trình đánh giá nội bộ về mức đủ thanh khoản tại ngân hàng thương mại. 2. Kinh nghiệm quốc tế về quy trình đánh giá đầy đủ về thanh khoản tại một số NHTM trên thế giới. 3. Đánh giá về khả năng áp dụng quy trình đánh giá nội bộ về mức đủ thanh khoản tại các NHTM Việt Nam. 4. Đề xuất khuyến nghị liên quan đến áp dụng quy trình đánh giá đầy đủ về thanh khoản tại các NHTM Việt Nam. <i>Yêu cầu đối với kết quả nghiên cứu:</i> - Đề tài cần làm rõ việc các NHTM nên áp dụng các tiêu chuẩn của Basel 2 hay Basel 3 về thanh khoản. - Đề tài cần phân tích tác động của việc tuân thủ Basel 3 đến hoạt động của ngân hàng và hiệu lực của chính sách tiền tệ thông qua đánh giá mô phỏng.
5	Giải pháp phát triển tín dụng tiêu dùng tại	ĐTNH.014/23	TS. Nguyễn Tường Vân,	<i>Mục tiêu nghiên cứu:</i> - Hệ thống hoá cơ sở lý luận về phát triển tín dụng tiêu dùng tại các tổ chức

	các tổ chức cho vay chính thức để góp phần hạn chế tín dụng đen tại Việt Nam.		Khoa Ngân hàng, Học viện Ngân hàng	cho vay chính thức, đánh giá thực trạng phát triển tín dụng tiêu dùng tại các tổ chức cho vay chính thức (cố gắng tìm kiếm, phát hiện các yếu tố ảnh hưởng đến hành vi chấp nhận vay nợ nặng lãi của các đối tượng dân cư). - Đề xuất một số giải pháp phát triển tín dụng tiêu dùng tại các tổ chức cho vay chính thức nhằm góp phần hạn chế tín dụng đen tại Việt Nam. Nội dung nghiên cứu: 1. Những vấn đề lý luận về giải pháp phát triển tín dụng tiêu dùng tại các tổ chức cho vay chính thức nhằm góp phần hạn chế tín dụng đen tại Việt Nam. 2. Kinh nghiệm nước ngoài: thực trạng/ hệ thống tài chính/ pháp luật và môi trường liên quan. 3. Thực trạng về tín dụng tiêu dùng ở Việt Nam (phía cung/cầu): mô tả và kết quả kiểm định... 4. Thực trạng về tín dụng ngoài hệ thống ngân hàng (tín dụng nặng lãi/ tín dụng đen) ở Việt Nam (phía cung/cầu): mô tả và kết quả kiểm định... 5. Giải pháp phát triển tín dụng tiêu dùng tại các tổ chức cho vay chính thức góp phần hạn chế tín dụng đen tại Việt Nam.
--	---	--	------------------------------------	---