



Вищий навчальний заклад
«НАЦІОНАЛЬНА АКАДЕМІЯ УПРАВЛІННЯ»
Факультет економіки та інформаційних технологій
Кафедра фінансів, обліку та фундаментальних економічних дисциплін



РОБОЧА ПРОГРАМА

МАКРОПРУДЕНЦІЙНИЙ НАГЛЯД

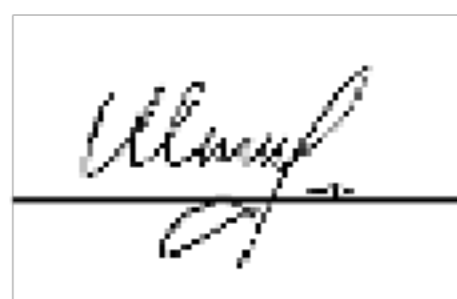
(назва навчальної дисципліни)

підготовки	<u>другого (магістерського) рівня вищої освіти</u> (назва рівня вищої освіти)
галузі знань	<u>07 «Управління та адміністрування»</u> (шифр і назва галузі знань)
спеціальності	<u>072 «Фінанси, банківська справа та страхування»</u> (код і найменування спеціальності)
освітньо-професійної програми	<u>«Фінанси, банківська справа та страхування»</u> (назва освітньо-професійної програми)
тип дисципліни	<u>професійної підготовки</u>

2020 рік

ПОГОДЖЕНО:

Гарант освітньої програми




Штулер І.Ю
(прізвище, ініціали)

РЕКОМЕНДОВАНО:

Кафедрою фінансів, обліку та
фундаментальних економічних дисциплін
протокол № 1
від «28» серпня 2020 року

Завідувач кафедри



Сугак Т.М.
(прізвище, ініціали)

Розробники: Нам Вікторія Геннадіївна, кафедра фінансів, обліку та фундаментальних економічних дисциплін.

1. Опис навчальної дисципліни

Мова навчання: українська.

Статус дисципліни: вибіркова.

Передумови вивчення навчальної дисципліни: оволодіння здобувачами вищої освіти знаннями з таких дисциплін як: «Фінанси», «Банківська справа», «Кредитний менеджмент», «Аналіз банківської діяльності» та набуття ними відповідних фахових компетенцій.

Предметом вивчення навчальної дисципліни «Макропруденційний нагляд» є теоретико-методологічні та регуляторні засади забезпечення стабільності фінансової системи.

Інформаційний обсяг навчальної дисципліни. На вивчення навчальної дисципліни відводиться **120** годин **4** кредити ECTS.

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Метою вивчення дисципліни «Макропруденційний нагляд» є набуття теоретичних знань та формування практичних навичок забезпечення фінансової стабільності й обґрунтування потреби регулювання вітчизняного ринку банківських послуг та процесу реалізації концепції макропруденційного нагляду та регулювання у банківському секторі.

Основними завданнями навчальної дисципліни «Макропруденційний нагляд» є поглиблення й розширення теоретичних і практичних знань в частині структури власності банків; дослідження реформ корпоративного управління; вивчення інструментів макропруденційної політики; впровадження нових вимог до капіталу відповідно до норм Базеля та законодавства ЄС; вивчення світових тенденцій в банківському регулюванні та нагляді; дослідження практичних аспектів оцінки кредитних ризиків у комерційних банках; вивчення Положення №351; дослідження підходів до банківського нагляду; застосування стрес-тестів як інструментів діагностики банків; вивчення відмінностей між монетарною та наглядовою статистикою та їх застосуванням; запровадження стандартів звітування FINREP та COREP.

3. Компетентності та заплановані результати навчання

Дисципліна «Макропруденційний нагляд» забезпечує набуття здобувачами вищої освіти **компетентностей:**

Загальні компетентності:

ЗК1. Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.

ЗК3. Здатність проведення досліджень на відповідному рівні.

ЗК4. Вміння виявляти, ставити та вирішувати проблеми.

ЗК5. Здатність приймати обґрунтовані рішення.

ЗК6. Навички міжособистісної взаємодії.

ЗК7. Здатність мотивувати людей та рухатися до спільної мети.

Спеціальні (фахові) компетенції:

СК1. Здатність використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності.

СК2. Здатність використовувати теоретичний та методичний інструментарій для діагностики і моделювання фінансової діяльності суб'єктів господарювання.

СК3. Здатність застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК4. Здатність оцінювати дієвість наукового, аналітичного і методичного інструментарію для обґрунтування управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК5. Здатність оцінювати межі власної фахової компетентності та підвищувати професійну кваліфікацію.

СК6. Здатність застосовувати міждисциплінарні підходи при розв'язанні складних задач і проблем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК7. Здатність до пошуку, використання та інтерпретації інформації, необхідної для вирішення професійних і наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК8. Здатність застосовувати інноваційні підходи в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

СК9. Здатність розробляти технічні завдання для проектування інформаційних систем у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

У результаті вивчення навчальної дисципліни «Макропруденційний нагляд» здобувач вищої освіти повинен досягти таких запланованих результатів навчання:

ПРН1. Використовувати фундаментальні закономірності розвитку фінансів, банківської справи та страхування у поєднанні з дослідницькими і управлінськими інструментами для здійснення професійної та наукової діяльності.

ПРН2. Знати на рівні новітніх досягнень основні концепції і методології наукового пізнання у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

ПРН4. Відшуковувати, обробляти, систематизувати та аналізувати інформацію, необхідну для вирішення професійних та наукових завдань в сфері фінансів, банківської справи та страхування.

ПРН8. Вміти застосовувати інноваційні підходи у сфері фінансів, банківської справи та страхування та управляти ними.

ПРН9. Застосовувати управлінські навички у сфері фінансів, банківської справи та страхування.

ПРН11. Застосовувати поглиблені знання в сфері фінансового, банківського та страхового менеджменту для прийняття рішень.

ПРН12. Обґрунтувати вибір варіантів управлінських рішень у сфері фінансів, банківської справи та страхування та оцінювати їх ефективність з урахуванням цілей, наявних обмежень, законодавчих та етичних аспектів.

4. Структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Обсяг у годинах											
	денна форма						заочна форма					
	усього	у тому числі					усього	у тому числі				
		л	сем.	пз	лаб	с.р		л	сем.	пз	лаб	с.р
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Змістовий модуль 1. Теоретико організаційні аспекти макропруденційного нагляду банку												
Тема 1. Поточні тенденції у банківському секторі.	14	2	2	-	-	10	13	1	-	-	-	12
Тема 2. Структура власності банків: ділова репутація. Реформа корпоративного управління.	14	2	2	-	-	10	12	-	-	-	-	12
Тема 3. Запровадження інструментів макропруденційної політики: нові вимоги до ліквідності.	14	2	2	-	-	10	15	1	1	-	-	13
Тема 4. Впровадження нових вимог до капіталу відповідно до норм Базеля та законодавства ЄС.	18	4	4	-	-	10	15	1	1	-	-	13
Разом за змістовим модулем 1	60	10	10	-	-	40	55	3	2	-	-	50
Змістовий модуль 2. Методичні основи застосування макропруденційного нагляду												
Тема 5. Світові тенденції в банківському регулюванні та нагляді.	9	1	2	-	-	6	11	-	1	-	-	10
Тема 6. Практичні аспекти оцінки кредитних ризиків у комерційних банках. Положення №351: вимоги НБУ до оцінки кредитних ризиків.	9	1	2	-	-	6	12	1	1	-	-	10
Тема 7. Підходи до банківського нагляду. Рух до європейських стандартів (SREP).	10	2	2	-	-	6	11	1	-	-	-	10
Тема 8. Стрес-тести як інструменти діагностики банків.	10	2	2	-	-	6	11	1	-	-	-	10
Тема 9. Відмінності між монетарною та наглядовою статистикою та їх застосуванням.	11	2	1	-	-	8	10	-	-	-	-	10
Тема 10. Запровадження стандартів звітування FINREP та COREP.	11	2	1	-	-	8	10	-	-	-	-	10
Разом за змістовим модулем 2	60	10	10	-	-	40	65	3	2	-	-	60
Усього годин	120	20	20	-	-	80	120	6	4	-	-	110

5. ЗМІСТ ПРОГРАМИ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Змістовий модуль 1.

ТЕОРЕТИКО-ОРГАНІЗАЦІЙНІ АСПЕКТИ МАКРОПРУДЕНЦІЙНОГО НАГЛЯДУ БАНКУ

Тема 1. Поточні тенденції у банківському секторі.

Ключові показники. Стратегії розвитку державних банків. Частка депозитів. Частка кредитів. Активи та пасиви державних банків. Держава – монополіст на ринку банківської ІТ інфраструктури. Фондування. Цінова та валютна стабілізація. Валютні заощадження. Очікування.

Тема 2. Структура власності банків: ділова репутація. Реформа корпоративного управління.

Функції ліцензування. Банківська ліцензія. Генеральна ліцензія на здійснення валютних операцій. Ліцензія на переказ коштів без відкриття рахунку. Ліцензія юридичним особам на інкасацію. Основні виклики ліцензування. Структура власності банків. Операції з пов'язаними особами. Докапіталізація

капіталу. Непрозорі структури власності. Вимоги до розкриття структури власності банків. Власник істотної участі. Ключові учасники та остаточні ключові учасники. Дискреційний траст. Ділова репутація. Корпоративне управління в банках. Принципи корпоративного управління. Напрямки реформи корпоративного управління в банках.

Тема 3. Запровадження інструментів макропруденційної політики: нові вимоги до ліквідності.

Становлення макропруденційної політики: ключові віхи. Нова світова парадигма: центральні банки / фінансові регулятори повинні узгоджувати три політики, інструменти макропруденційної політики. Нові вимоги до ліквідності. Нові вимоги до ліквідності в контексті України.

Тема 4. Впровадження нових вимог до капіталу відповідно до норм Базеля та законодавства ЄС.

Вимоги до капіталу: норми ЄС: Базель III, CRR/CRD IV. Запровадження норм ЄС в Україні. Посилення вимог до капіталу: норми ЄС. Структура капіталу: Україна та норми ЄС. Інструменти ДК 1-го рівня, тригерна подія. Leverage ratio. Імплементация нових вимог до капіталу в Україні.

Змістовий модуль 2.

МЕТОДИЧНІ ОСНОВИ ЗАСТОСУВАННЯ МАКРОПРУДЕНЦІЙНОГО НАГЛЯДУ

Тема 5. Світові тенденції в банківському регулюванні та нагляді.

Історія розвитку законодавчих актів Базельського комітету щодо банківського нагляду. Розрахунок достатності капіталу Базель I. Необхідність переходу до Базеля II. Структура Базеля II. Реформи фінансового регулювання G20. Базель III. Реформи щодо системно важливих фінансових установ.

Тема 6. Практичні аспекти оцінки кредитних ризиків у комерційних банках. Положення №351: вимоги НБУ до оцінки кредитних ризиків.

Практика управління кредитним ризиком у банках. Складові кредитного процесу. Економічний капітал та складові розрахунку. Моделі оцінки параметрів кредитного ризику. Процес побудови рейтингових моделей. Зміст Положення №351. Розрахунок розміру кредитного ризику.

Тема 7. Підходи до банківського нагляду. Рух до європейських стандартів (SREP).

Процес наглядових оцінок та перевірок (SREP). Кроки впровадження (SREP). Розподіл анків за категоріями (пропорційність нагляду). Визначення бізнес-моделей банків. Розрахунок оцінки SREP.

Тема 8. Стрес-тести як інструменти діагностики банків.

Стрес-тести: визначення та міжнародний досвід. Вибір підходів до стрес-тестування. Стрес-тестування українських банків: підхід НБУ. Діагностика. Базовий макроекономічний сценарій. Модель стрес-тестування. Балансова модель.

Тема 9. Відмінності між монетарною та наглядовою статистикою та їх застосуванням.

Монетарна статистика та наглядова статистика. Принципи використання різних видів статистики. Монетарна статистика в НБУ. Класифікація фінансових інструментів за монетарною та наглядовою статистикою.

Тема 10. Запровадження стандартів звітування FINREP та COREP.

Європейська система фінансового нагляду: регулятори та підзвітні фінансові організації. Розвиток фінансової звітності та звітності для пруденційних цілей в Європі. Досвід комунікації статистичних даних на прикладі ЄЦБ, Польщі, Чехії та Румунії. Досвід Європейського центрального банку (ЄЦБ) з узгодження вимог до статистичної та фінансової звітності кредитних установ.

6. Теми лекцій

№ з/п	Назва теми	Обсяг у годинах	
		Денна форма	Заочна форма
1	Тема 1. Поточні тенденції у банківському секторі.	2	1
2	Тема 2. Структура власності банків: ділова репутація. Реформа корпоративного управління.	2	-
3	Тема 3. Запровадження інструментів макропруденційної політики: нові вимоги до ліквідності.	2	1
4	Тема 4. Впровадження нових вимог до капіталу відповідно до норм Базеля та законодавства ЄС.	4	1
5	Тема 5. Світові тенденції в банківському регулюванні та нагляді.	1	-
6	Тема 6. Практичні аспекти оцінки кредитних ризиків у комерційних банках. Положення №351: вимоги НБУ до оцінки кредитних ризиків.	1	1
7	Тема 7. Підходи до банківського нагляду. Рух до європейських стандартів (SREP).	2	1
8	Тема 8. Стрес-тести як інструменти діагностики банків.	2	1
9	Тема 9. Відмінності між монетарною та наглядовою статистикою та їх застосуванням.	2	-
10	Тема 10. Запровадження стандартів звітування FINREP та COREP.	2	-
Усього годин		20	6

7. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Обсяг у годинах	
		Денна форма	Заочна форма
1	Не передбачено навчальним планом	-	-
Усього годин			

8. Теми семінарських занять

№ з/п	Назва теми	Обсяг у годинах	
		Денна форма	Заочна форма
1	Тема 1. Поточні тенденції у банківському секторі.	2	-
2	Тема 2. Структура власності банків: ділова репутація. Реформа корпоративного управління.	2	-
3	Тема 3. Запровадження інструментів макропруденційної політики: нові вимоги до ліквідності.	2	1
4	Тема 4. Впровадження нових вимог до капіталу відповідно до норм Базеля та законодавства ЄС.	4	1
5	Тема 5. Світові тенденції в банківському регулюванні та нагляді.	2	1
6	Тема 6. Практичні аспекти оцінки кредитних ризиків у комерційних банках. Положення №351: вимоги НБУ до оцінки кредитних ризиків.	2	1
7	Тема 7. Підходи до банківського нагляду. Рух до європейських стандартів (SREP).	2	-
8	Тема 8. Стрес-тести як інструменти діагностики банків.	2	-
9	Тема 9. Відмінності між монетарною та наглядовою статистикою та їх застосуванням.	1	-
10	Тема 10. Запровадження стандартів звітування FINREP та COREP.	1	-
Усього годин		20	4

9. Теми лабораторних занять

№ з/п	Назва теми	Обсяг у годинах	
		Денна форма	Заочна форма
1	Не передбачено навчальним планом	-	-
Усього годин			

10. Теми самостійної роботи

№ з/п	Назва теми	Обсяг у годинах	
		Денна форма	Заочна форма
1	Тема 1. Поточні тенденції у банківському секторі.	10	12
2	Тема 2. Структура власності банків: ділова репутація. Реформа корпоративного управління.	10	12
3	Тема 3. Запровадження інструментів макропруденційної політики: нові вимоги до ліквідності.	10	13
4	Тема 4. Впровадження нових вимог до капіталу відповідно до норм Базеля та законодавства ЄС.	10	13
5	Тема 5. Світові тенденції в банківському регулюванні та нагляді.	6	10
6	Тема 6. Практичні аспекти оцінки кредитних ризиків у комерційних банках. Положення №351: вимоги НБУ до оцінки кредитних ризиків.	6	10
7	Тема 7. Підходи до банківського нагляду. Рух до європейських стандартів (SREP).	6	10
8	Тема 8. Стрес-тести як інструменти діагностики банків.	6	10
9	Тема 9. Відмінності між монетарною та наглядовою статистикою та їх застосуванням.	8	10
10.	Тема 10. Запровадження стандартів звітування FINREP та COREP.	8	10
Усього годин		80	110

11. Завдання для самостійної роботи

1. Передумови виникнення і становлення фінансового нагляду.
2. Мета, об'єкт і предмет фінансового нагляду.
3. Напрями фінансового нагляду.
4. Напрямки реформи корпоративного управління в банках.
5. Класифікація фінансового нагляду за стадіями здійснення та реалізації.
6. Форми нагляду за фінансовим сектором та їх характеристика.
7. Становлення та еволюція банківського нагляду.
8. Мета, завдання, об'єкт і предмет нагляду за банківською діяльністю.
9. Принципи банківського нагляду.
10. Базель I, II і III: порівняння вимог до діяльності банків.
11. Принципи банківського нагляду в Україні.
12. Інституційна структура банківського нагляду в Україні.
13. Організація безвизного банківського нагляду.
14. Економічні нормативи діяльності банків.
15. Порядок інспектування банків.
16. Макропруденційний нагляд як сучасна концепція розвитку фінансового нагляду.
17. Сутність фінансової стійкості та системного ризику фінансового сектору.
18. Науково-методичний інструментарій оцінювання стійкості фінансового сектору.
19. Стрес-тестування та його аналітичні можливості.
20. Моделі інституційної організації макропруденційного нагляду.

12. Питання для підготовки до підсумкового контролю (диференційованого заліку)

1. Стратегії розвитку державних банків.
2. Частка депозитів та кредитів.
3. Цінова та валютна стабілізація. Валютні заощадження. Очікування.
4. Функції ліцензування. Банківська ліцензія.
5. Генеральна ліцензія на здійснення валютних операцій.
6. Ліцензія на переказ коштів без відкриття рахунку.
7. Ліцензія юридичним особам на інкасацію.
8. Основні виклики ліцензування.
9. Структура власності банків.
10. Операції з пов'язаними особами.
11. Докапіталізація капіталу.
12. Вимоги до розкриття структури власності банків.
13. Ключові учасники та остаточні ключові учасники.
14. Ділова репутація.
15. Корпоративне управління в банках.
16. Становлення макропруденційної політики: ключові віхи.
17. Нова світова парадигма: центральні банки / фінансові регулятори повинні узгоджувати три політики.
18. Інструменти макропруденційної політики.
19. Вимоги до капіталу: норми ЄС: Базеля III, CRR/CRD IV.
20. Запровадження норм ЄС в Україні.
21. Структура капіталу: Україна та норми ЄС.
22. Історія розвитку законодавчих актів Базельського комітету щодо банківського нагляду.
23. Розрахунок достатності капіталу Базель I.
24. Структура Базеля II.
25. Базель III. Реформи щодо системно важливих фінансових установ.
26. Практика управління кредитним ризиком у банках.
27. Моделі оцінки параметрів кредитного ризику.
28. Зміст Положення №351. Розрахунок розміру кредитного ризику.
29. Процес наглядових оцінок та перевірок (SREP). Кроки впровадження (SREP).
30. Розподіл банків за категоріями (пропорційність нагляду).
31. Визначення бізнес-моделей банків. Розрахунок оцінки SREP.
32. Стрес-тести: визначення та міжнародний досвід.
33. Вибір підходів до стрес-тестування.
34. Стрес-тестування українських банків: підхід НБУ.
35. Модель стрес-тестування.
36. Монетарна статистика та наглядова статистика.
37. Класифікація фінансових інструментів за монетарною та наглядовою статистикою.
38. Європейська система фінансового нагляду: регулятори та підзвітні фінансові організації.
39. Розвиток фінансової звітності та звітності для пруденційних цілей в Європі.
40. Досвід комунікації статистичних даних на прикладі ЄЦБ, Польщі, Чехії та Румунії.
41. Досвід Європейського центрального банку (ЄЦБ) з узгодження вимог до статистичної та фінансової звітності кредитних установ.

13. Методи навчання

1. Методи навчання на лекціях: вербальний метод (лекція, дискусія тощо); методи візуалізації (презентація, графічна та таблицна ілюстрація, метод демонстрацій тощо); робота з навчально-методичною літературою (конспектування, анотування тощо); інші методи у сполученні з новітніми інформаційними технологіями та комп'ютерними засобами навчання (дистанційні, мультимедійні, веб-орієнтовані тощо);

2. Методи навчання на семінарських заняттях: вербальний метод (дискусія, співбесіда тощо); практичний метод (метод візуалізації (презентація, графічна та таблична ілюстрація, метод демонстрацій та інші); дослідницький метод, пошуковий метод (робота з навчально-методичною літературою: рецензування, підготовка реферату, есе, доповіді тощо); інші методи у сполученні з новітніми інформаційними технологіями та комп'ютерними засобами навчання (дистанційні, мультимедійні, веб-орієнтовані тощо); кейс-метод (вирішення ситуацій, розв'язання завдань тощо); метод проблемного виконання, репродуктивний метод.

14. Методи оцінювання

У процесі вивчення дисципліни «Макропруденційний нагляд» використовуються такі методи оцінювання:

- для поточного контролю у вигляді: *усного та письмового опитування, фронтального опитування, доповідей, тестування, вирішення ситуаційних завдань, розв'язування задач, написання есе (рефератів), виконання індивідуальних завдань тощо.*

- для модульного контролю у вигляді: *письмової відповіді (теоретичні питання, тестування, вирішення ситуаційних завдань, розв'язування задач тощо).*

- для підсумкового контролю у вигляді *диференційованого заліку у формі письмової відповіді (теоретичні питання, вирішення ситуаційних завдань, розв'язування задач тощо).*

15. Засоби діагностики результатів навчання

Робоча програма передбачає застосування засобів діагностики результатів навчання за формами контролю знань:

- *поточний контроль* може передбачати застосування широкого спектру форм та методів оцінювання знань, що проводиться за кожною темою.
- *модульний контроль* передбачає письмове виконання різних видів контрольних завдань.
- *підсумковий контроль* передбачає проведення екзамену або заліку.

Завершальним етапом досягнення запланованих програмних результатів навчання з навчальної дисципліни «Макропруденційний нагляд» є підсумковий контроль – диференційований залік.

16. Критерії та порядок оцінювання результатів навчання

Для оцінювання знань здобувачів вищої освіти застосовуються контрольні заходи у формі поточного, модульного та підсумкового контролю знань у відповідності до «Положення про оцінювання знань здобувачів вищої освіти».

Поточний контроль

Види навчальної діяльності здобувачів вищої освіти обираються та оцінюються викладачем за рекомендованою шкалою в залежності від особливостей навчальної дисципліни. Оцінювання окремих видів навчальної діяльності здобувача вищої освіти для дисципліни «Макропруденційний нагляд» відбувається за такими рекомендованими балами:

Види навчальної діяльності здобувачів вищої освіти	Кількість балів
Аудиторна робота	
Відповідь на практичному, семінарському, лабораторному занятті	1-5
Вирішення ситуаційних завдань, розв'язання задач тощо	1-5
Тестування	1-5
Ділова гра, практичний кейс тощо	1-10
Інші види аудиторної роботи*	

Самостійна робота	
Реферат, есе тощо	1-10
Інші види навчальної діяльності здобувачів вищої освіти (участь у публічних заходах (конференція, олімпіада тощо); написання наукової статті, участь у конкурсах студентських робіт тощо)	1-10
Інші види самостійної роботи*	
Контрольна робота (для заочної форми здобуття освіти)	1-50

*види навчальної діяльності здобувачів освіти обираються та оцінюються викладачем за рекомендованою шкалою в залежності від особливостей навчальної дисципліни.

Для визначення ступеня засвоєння навчального матеріалу та поточного оцінювання знань здобувачів вищої освіти застосовуються критерії у відповідності до «Положення про оцінювання знань здобувачів вищої освіти».

Модульний контроль

Навчальна дисципліна «Макропроденційний нагляд» передбачає виконання двох модульних контрольних робіт. Модульна контрольна робота з навчальної дисципліни «Макропроденційний нагляд» оцінюється в **10 балів**. Максимальна сумарна кількість балів за модульний контроль складає **20 балів**.

Здобувач вищої освіти допускається до підсумкового контролю у разі набрання ним за результатами поточного та модульного контролю не менше **20 балів**.

Для визначення ступеня засвоєння (змістового модуля) навчальної дисципліни та контрольного оцінювання знань здобувачів вищої освіти застосовуються критерії у відповідності до «Положення про оцінювання знань здобувачів вищої освіти».

Підсумковий контроль

Максимальна кількість балів за диференційований залік з навчальної дисципліни «Макропроденційний нагляд» складає **40 балів**.

Для визначення ступеня засвоєння навчальної дисципліни та контрольного оцінювання знань здобувачів вищої освіти за підсумковим контролем застосовуються критерії у відповідності до «Положення про оцінювання знань здобувачів вищої освіти».

Підсумкова оцінка переводиться у національну систему оцінювання і шкалу ECTS згідно таблиці:

Порядок переведення оцінок у систему ECTS

Сума балів за всі види навчальної діяльності	ОЦІНКА ECTS	ОЦІНКА ЗА НАЦІОНАЛЬНОЮ ШКАЛОЮ	
		для екзамену курсової роботи (проекту), практики	для заліку (диференційованого заліку)
90-100	A	відмінно	зараховано
82-89	B	добре	
75-81	C		
64-74	D	задовільно	
60-63	E		
35-59	FX	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання
1-34	F	незадовільно з обов'язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов'язковим повторним вивченням дисципліни

17. Розподіл балів, які отримують здобувачі вищої освіти

Для денної форми здобуття освіти

Поточний контроль та самостійна робота - 60										Самостійна робота	Підсумковий контроль	Сума
Змістовий модуль 1				Змістовий модуль 2								
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	T10	10	40	100
3	3	3	3	3	3	3	3	3	3			
Модульний контроль 1 - 10				Модульний контроль 2 - 10								

Для заочної форми здобуття освіти

Поточний контроль та самостійна робота - 60		Підсумковий контроль	Сума
Контрольна робота	Самостійна робота		
50	10	40	100

18. Методичне забезпечення

Методичне забезпечення дисципліни «Макропруденційний нагляд» узагальнено в комплексі навчально-методичного забезпечення, який включає:

- силабус;
- робочу програму навчальної дисципліни;
- методичні вказівки до вивчення дисципліни;
- варіанти завдань для самостійної та індивідуальної роботи студентів;
- варіанти завдань для модульного контролю;
- варіанти завдань для підсумкового контролю;
- інші матеріали.

19. Рекомендована література

Основна

1. Нам В.Г. *Фінансовий менеджмент: Навчально-методичний посібник для самостійного вивчення дисципліни*// Колектив авторів/ Антонова О.М., Штань М.В., Неговська Ю.М., Сугак Т.М., Чередніченко Ю.В., Браславець О. Ю., Нам В.Г. – К.: – Національна академія управління, 2019. – 162 с.

2. Суміна, О. С. (2017). *Особливості банківського нагляду на макропруденційній основі в Україні. Аллея науки*, (7), 285-294.

3. Хоружий, С. Г. (2019). *Особливості регулювання і нагляду за діяльністю фінансових установ в ЄС. Облік і фінанси*, (4), 106-111.

Допоміжна

1. Алімпієв, Є. В. (2018). *Макропруденційні умови національної безпеки. Вчені записки Університету «КРОК»*, (49), 4-11.

2. Хоружий, С. Г. (2019). *Особливості регулювання і нагляду за діяльністю фінансових установ в ЄС. Облік і фінанси*, (4), 106-111.

3. Клименко, Д. Б., & Підсосонна, Я. Г. (2018). *Впровадження макропруденційної політики в Україні. Збірник наукових праць Університету державної фіскальної служби України*, (1), 61-74.

4. Коваленко, В. В. (2018). *Регулювання та нагляд за кредитними установами. Держава та регіони. Серія: Економіка та підприємництво*, (4), 185-192.

5. Шевчук, А. (2018). Підвищення капіталізації банківської системи України шляхом макропруденційного регулювання національного банку України. *Науковий вісник [Одеського національного економічного університету]*, (8), 190-211.
6. Дишлевий, Р. В. (2020). Інструменти макропруденційної політики.
7. Khoguzhyi, S. (2019). Класифікація моделей регулювання і нагляду за діяльністю фінансових установ. *Економічний аналіз*, 29(1), 101-107.
8. Пирог, О. В., & Катан, В. О. ІМПЛЕМЕНТАЦІЯ ЄВРОПЕЙСЬКОГО ДОСВІДУ БАНКІВСЬКОГО РЕГУЛЮВАННЯ ТА БАНКІВСЬКОГО НАГЛЯДУ В УКРАЇНІ. *Матеріали друкуються в авторській редакції. Погляди, висловлені в публікаціях, є виключно позицією авторів. Відповідальність за науковий рівень публікацій, обґрунтованість висновків, достовірність результатів, наявність плагіату несуть автори. Матеріали публікуються в авторській редакції. Взгляды, изложенные в,* 59.
9. Суміна, О. С. (2017). ОСОБЛИВОСТІ БАНКІВСЬКОГО НАГЛЯДУ НА МАКРОПРУДЕНЦІЙНІЙ ОСНОВІ В УКРАЇНІ. *Алея науки*, (7), 285-294.
10. Павлюк, О. О. (2018). Розвиток систем банківського нагляду в країнах Східної Європи. *Науковий вісник Ужгородського університету. Серія «Економіка»*, (1 (51)), 356-362.
11. Хоружий, С. Г. СВІТОВІ ТЕНДЕНЦІЇ У РОЗВИТКУ МОДЕЛЕЙ РЕГУЛЮВАННЯ І НАГЛЯДУ ЗА ДІЯЛЬНІСТЮ ФІНАНСОВИХ УСТАНОВ. *Проблеми забезпечення ефективного функціонування та стабільного розвитку банківської системи та економіки: тези доповідей учасників VIII*, 132.
12. Kudyn, S. I., & Hurs'ka, M. O. МАКРОПРУДЕНЦІЙНА ПОЛІТИКА ЯК ЗАСІБ ПІДТРИМАННЯ ФІНАНСОВОЇ БЕЗПЕКИ ДЕРЖАВИ.

20. Інформаційні ресурси, у т.ч. в мережі Інтернет

Органи державного управління і національні інститути

Офіційна сторінка Президента України www.president.gov.ua

Урядовий портал Кабінету Міністрів України www.kmu.gov.ua

Національний банк України www.bank.gov.ua

Міністерство розвитку економіки, торгівлі та сільського господарства України www.me.gov.ua

Міністерство фінансів України www.minfin.gov.ua

Державний інформаційно-аналітичний центр моніторингу зовнішніх товарних ринків «Держзовнішінформ» www.ukrdzi.com

Національні науково-дослідні інститути та центри

Національний інститут стратегічних досліджень www.niss.gov.ua

Український центр економічних і політичних досліджень імені Олександра Разумкова www.uceps.org

Інститут економічних досліджень і політичних консультацій www.ier.kiev.ua

База українського законодавства в Інтернет www.lawukraine.com

Наукові та електронні бібліотеки в Україні

Національна бібліотека України імені В.І.Вернадського www.nbuv.gov.ua

Національна парламентська бібліотека www.alpha.rada.kiev.ua

Електронна бібліотека Львівської комерційної академії www.dev.lac.lviv.ua/lib

Наукова бібліотека імені Максимовича www.lib-gw.univ.kiev.ua

Дніпропетровська обласна наукова бібліотека www.libr.dp.ua

Вінницька державна обласна універсальна наукова бібліотека імені К.А.Тімірязєва www.library.vinnitsa.com

Львівська електронна бібліотека імені В.Стефаніка www.lsl.lviv.ua

Одеська державна наукова бібліотека імені М.Горького www.ognb.odessa.ua

Велика економічна бібліотека www.economics.com.ua

Електронна бібліотека www.lib.com.ua

Міжнародні економічні і фінансові організації

Міжнародний валютний фонд (МВФ) (The International Monetary Fund) www.imf.org

Організація об'єднаних націй (ООН) (United Nations Organization) www.un.org

Світова організація торгівлі (СОТ) (The World Trade Organization) www.wto.org

Група Світового банку (The World Bank Group) www.worldbank.org

Міжнародний банк реконструкції і розвитку (МБРР) (International Bank for Reconstruction and Development) www.worldbank.org/ibrd

Органи статистики

Державна служба статистики України www.ukrstat.gov.ua

U.S. Department of the Treasury www.ustreas.gov

Bureau of the Public Debt T-Bill, Notes and Bonds www.publicdebt.treas.gov

U.S. Bureau of Economic Analysis www.bea.doc.gov

U.S. Department of Commerce www.doc.gov

National Bureau of Economic Research www.nber.org

Investment Company Institute www.ici.org

Joint Economic Committee www.house.gov

Statistics Canada www.statcan.ca

U.K. Office of National Statistics www.ons.gov.uk

Japan Economic Planning Agency www.epa.go.jp

German Federal Statistical Office www.statistik-bund.de

German Finance Ministry www.bundesfinanzministerium.de

German Federal Economics Office www.bawi.de