

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ


"ЗАТВЕРДЖУЮ"
Заступник керівника
(професор з науково-педагогічної роботи)

Микола АФАНАСЬЄВ

СТАТИСТИКА БАНКІВСЬКИХ ПРОЦЕСІВ

робоча програма навчальної дисципліни

Галузь знань
Спеціальність
Освітній рівень
Освітні програми

**07 Управління та адміністрування
072 Фінанси, банківська справа та страхування
перший (бакалаврський)
банківська справа**

Вид дисципліни
Мова викладання, навчання та оцінювання

*вибіркова
українська*

Завідувач кафедри
банківської справи і фінансових послуг



Олег КОЛОДІЗЄВ

ЗАТВЕРДЖЕНО

на засіданні кафедри банківської справи і фінансових послуг.
Протокол № 19 від 01.09.2020 р.

Розробник:

Корват О.В., к.е.н., доц. кафедри банківської справи і фінансових послуг.

**Лист оновлення та перезатвердження
робочої програми навчальної дисципліни**

Навчальний рік	Дата засідання кафедри – розробника РПНД	Номер протоколу	Підпис завідувача кафедри

Анотація навчальної дисципліни

Статистика є основним інструментом збирання, обробки й аналізу даних, а також інформаційно-аналітичним забезпеченням прийняття рішень у банківській діяльності. Закріплення в результаті вивчення дисципліни «Статистика банківських процесів» знань з теорії статистики та набуття практичних навичок проведення статистичних досліджень у банківській сфері приносять формуванню компетентного фахівця банківської справи.

Об'єктами навчальної дисципліни «Статистика банківських процесів» є ідентифікація, оцінювання та вивчення закономірностей і взаємозв'язків масових процесів і динамічних явищ у банківській діяльності статистичними методами.

Предмет дисципліни – теоретичні, методичні й прикладні аспекти статистичних досліджень банківських процесів.

Мета навчальної дисципліни: підготовка фахівців, здатних розв'язувати складні спеціалізовані завдання та прикладні проблеми з організації та проведення статистичних досліджень банківських процесів. Для досягнення мети поставлені такі основні завдання: набуття студентом стійких знань у сфері банківської статистики, оволодіння практичними навичками обґрунтування методів статистичних досліджень банківських процесів, розробки планів статистичних спостережень, пошуку, збирання та систематизації банківської статистичної інформації, розрахунку показників банківської статистики, аналізу й інтерпретації результатів дослідження банківських процесів, виявлення статистичних закономірностей, візуалізації результатів статистичних досліджень.

Характеристика навчальної дисципліни

Курс	4
Семестр	7
Кількість кредитів ECTS	4
Форма підсумкового контролю	Залік

Структурно-логічна схема вивчення дисципліни

Пререквізити	Постреквізити
Банківська справа	Фінансовий менеджмент у банку
Статистика	Банківське регулювання та нагляд

Компетентності та результати навчання за дисципліною

Компетентності	Результати навчання
Здатність демонструвати поглиблені знання з у сфері банківської статистики	Знання з теорії та практики проведення статистичних досліджень банківських процесів
Здатність розробляти плани статистичних спостережень	Навички розробки планів статистичних спостережень
Здатність вести пошук, збирати та систематизувати банківську статистичну інформацію	Навички пошуку, збирання та систематизації банківської статистичної інформації
Здатність розраховувати показники банківської статистики	Навички розрахунку показників банківської статистики
Здатність обґрунтовувати методи статистичних досліджень банківських процесів	Навички обґрунтування статистичних досліджень банківських процесів
Здатність використовувати методичний інструментарій прикладної статистики, застосовувати сучасні інформаційно-комп'ютерні технології для обробки даних статистичних спостережень	Володіння методичним інструментарієм прикладної статистики та сучасними інформаційно-комп'ютерними технологіями для обробки даних статистичних спостережень

Компетентності	Результати навчання
Здатність аналізувати та інтерпретувати результати дослідження банківських процесів, виявляти статистичні закономірності	Навички аналізу й інтерпретації результатів дослідження банківських процесів, виявлення статистичних закономірностей
Здатність візуально представляти результати статистичних досліджень	Навички візуалізації результатів статистичних досліджень
Здатність розв'язувати складні спеціалізовані завдання та прикладні проблеми з організації та проведення статистичних досліджень банківських процесів	Навички щодо вирішення складних завдань і прикладних проблем з організації та проведення статистичних досліджень банківських процесів

Програма навчальної дисципліни

Змістовий модуль 1. Основи банківської статистики

Тема 1. Предмет, метод і завдання банківської статистики

Тема 2. Теоретичні та прикладні основи статистичного вивчення банківських процесів

Тема 3. Показники банківської статистики

Змістовий модуль 2. Державна банківська статистика

Тема 4. Державна статистична діяльність

Тема 5. Загальнобанківська статистика

Тема 6. Грошово-кредитна статистика

Тема 7. Статистика банківського нагляду

Тема 8. Статистика операцій з іноземною валютою

Змістовий модуль 3. Статистика процесів банківської установи

Тема 9. Статистика кредитної діяльності банку

Тема 10. Статистика активних і пасивних операцій банку

Тема 11. Статистика доходів і витрат банку

Тема 12. Статистичне оцінювання ефективності банківської діяльності

Тема 13. Статистика ризиків діяльності та стійкості банку

Тема 14. Статистичне забезпечення банківського маркетингу

Перелік практичних (семінарських) та лабораторних занять, а також питань та завдань до самостійної роботи наведено у таблиці "Рейтинг-план навчальної дисципліни".

Методи навчання та викладання

У процесі викладання навчальної дисципліни для активізації навчально-пізнавальної діяльності студентів передбачене застосування як активних, так і інтерактивних навчальних технологій, серед яких: міні-лекції-діалоги, міні-лекції проблемного характеру, кейс-метод.

Порядок оцінювання результатів навчання

ХНЕУ ім. С. Кузнеця використовує накопичувальну (100-бальну) систему оцінювання сформованих компетентностей. Заходи з оцінювання результатів навчання студента за навчальною дисципліною включають:

поточний контроль, що здійснюється протягом семестру під час проведення лекційних, практичних (семінарських) і лабораторних занять, оцінюється сумою набраних балів (максимальна сума – 60 балів);

підсумковий/семестровий контроль, що проводиться у формі заліку (письмової підсумкової контрольної роботи) (максимум 40 балів).

Методи поточного контролю мають різну питому вагу у формуванні компетентностей студента, які забезпечуються навчальною дисципліною.

Максимальна кількість балів, що отримується на лекційних заняттях дорівнює 12 балів.

На практичних і лабораторних заняттях студентом може бути отримано максимально 40 балів: за виконання завдань на практичних заняттях – 6 балів, на лабораторних – 18 балів, за модульні контрольні роботи – 16 балів.

Самостійна робота студента з вивчення теоретичного матеріалу, виконання практичних завдань, підготовка до модульних контрольних робіт перевіряється під час аудиторних занять. Виконання самостійних індивідуальних завдань оцінюється в межах 8 балів.

Підсумковий контроль знань і компетентностей студента з навчальної дисципліни здійснюється на підставі проведення письмової підсумкової контрольної роботи, завданням якої є оцінювання рівня компетентностей студента з навчальної дисципліни, зокрема перевірка розуміння студентом програмного матеріалу в цілому, логіки та взаємозв'язків між окремими розділами, здатності творчого використання накопичених знань, вміння формулювати своє ставлення до певної проблеми навчальної дисципліни. Максимальна кількість балів за підсумкову контрольну роботу – 40 балів.

Студента слід **вважати атестованим**, якщо сума балів, одержаних за результатами підсумкової/семестрової перевірки успішності, дорівнює або перевищує 60.

Підсумкова оцінка з навчальної дисципліни розраховується з урахуванням балів, отриманих під час заліку (підсумкової контрольної роботи), та балів, отриманих під час поточного контролю за накопичувальною системою. Сумарний результат у балах за семестр складає: "60 і більше балів – зараховано", "59 і менше балів – не зараховано" та заноситься у залікову "Відомість обліку успішності" навчальної дисципліни.

Виставлення підсумкової оцінки здійснюється за шкалою, наведеною в таблиці "Шкала оцінювання: національна та ЄКТС".

Форми оцінювання та розподіл балів представлено в таблиці "Рейтинг-план навчальної дисципліни".

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка ЄКТС	Оцінка за національною шкалою	
		для іспиту, курсового проекту (роботи), практики	для заліку
90 – 100	A	відмінно	зараховано
82 – 89	B	добре	
74 – 81	C		
64 – 73	D		
60 – 63	E	задовільно	не зараховано
35 – 59	FX	незадовільно	
1 – 34	F		

Рейтинг-план навчальної дисципліни

Тема	Форми та види навчання		Форми оцінювання	Мак бал
Змістовий модуль 1. Основи банківської статистики				
Тема 1. Предмет, метод і завдання банківської статистики	Аудиторна робота			
	Лекції	Лекція. Предмет, метод і завдання банківської статистики Міні-лекція-діалог. Роль статистики у вирішенні завдань сфери банківських послуг	Активна робота на лекції	0,5
	Самостійна робота			
Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу			

Тема 2. Теоретичні та прикладні основи статистичного вивчення банківських процесів	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Теоретичні та прикладні основи статистичного вивчення банківських процесів	Активна робота на лекції	0,5
	Практичне заняття	Практичне заняття. Теоретичні та прикладні основи статистичного вивчення банківських процесів	Виконання практичних завдань	0,5
	Лабораторне заняття	Лабораторне заняття. Розробка планів статистичних спостережень банківських процесів	Виконання практичних завдань	2,0
	<i>Самостійна робота</i>			
Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; оформлення звіту з лабораторної роботи			
Тема 3. Показники банківської статистики	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Показники банківської статистики Міні-лекція проблемного характеру. Формування системи показників банківської статистики	Активна робота на лекції	1,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Показники банківської статистики	Виконання практичних завдань	0,5
	Лабораторне заняття	Лабораторне заняття. Інформаційно-комп'ютерні технології в статистичних дослідженнях	Виконання практичних завдань	2,0
	<i>Самостійна робота</i>			
Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; оформлення звіту з лабораторної роботи			
Змістовий модуль 2. Державна банківська статистика				
Тема 4. Державна статистична діяльність	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекція	Лекція. Державна статистична діяльність Міні-лекція-діалог. Актуалізація даних державної статистики	Активна робота на лекції	1,0
	Практичне заняття	Семінарське заняття. Державна статистична діяльність	Виконання практичних завдань	0,2
	<i>Самостійна робота</i>			
Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; виконання індивідуального завдання			

Тема 5. Загальнобанківська статистика	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекція	Лекція. Загальнобанківська статистика	Активна робота на лекції	0,5
	Практичне заняття	Практичне заняття. Загальнобанківська статистика	Виконання практичних завдань	0,2
	<i>Самостійна робота</i>			
	Завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями		
Тема 6. Грошово-кредитна статистика	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Грошово-кредитна статистика	Активна робота на лекції	0,5
	Практичне заняття	Практичне заняття. Грошово-кредитна статистика	Виконання практичних завдань	0,2
	<i>Самостійна робота</i>			
	Завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями		
Тема 7. Статистика банківського нагляду	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Статистика банківського нагляду	Активна робота на лекції	0,5
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистика банківського нагляду	Виконання практичних завдань	0,2
	<i>Самостійна робота</i>			
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; виконання індивідуального завдання; підготовка до модульної контрольної роботи		
Тема 8. Статистика операцій з іноземною валютою	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Статистика операцій з іноземною валютою	Активна робота на лекції	0,5
			Модульна контрольна робота	8,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистика операцій з іноземною валютою	Виконання практичних завдань	0,2
<i>Самостійна робота</i>				
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; підготовка до модульної контрольної роботи; виконання індивідуального завдання	Захист індивідуального завдання	4,0

Змістовий модуль 3. Статистика процесів банківської установи				
Тема 9. Статистика кредитної діяльності банку	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Статистика кредитної діяльності банку	Активна робота на лекції	2,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистика кредитної діяльності банку	Виконання практичних завдань	0,5
	Лабораторне заняття	Лабораторна робота. Побудова моделі даних у Power BI для проведення статистичного дослідження	Виконання практичних завдань	2,0
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; оформлення звіту з лабораторної роботи		
Тема 10. Статистика активних і пасивних операцій банку	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Статистика активних і пасивних операцій банку	Активна робота на лекції	1,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистика активних і пасивних операцій банку	Виконання практичних завдань	0,5
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; виконання індивідуального завдання		
	<i>Самостійна робота</i>			
Тема 11. Статистика доходів і витрат банку	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекція	Лекція. Статистика доходів і витрат банку	Активна робота на лекції	1,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистика доходів і витрат банку	Виконання практичних завдань	0,5
	Лабораторне заняття	Лабораторна робота. Обробка даних статистичного спостереження банківських процесів у Power BI	Виконання практичних завдань	4,0
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; оформлення звіту з лабораторної роботи		
Тема 12. Статистичне оцінювання ефективності банківської діяльності	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекції	Лекція. Статистичне оцінювання ефективності банківської діяльності Міні-лекція-діалог. Особливості статистичного оцінювання ефективності в умовах інфляції	Активна робота на лекції	1,0
	Лабораторне заняття	Лабораторна робота. Обробка даних статистичного спостереження банківських процесів у Power BI	Виконання практичних завдань	4,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистичне оцінювання ефективності банківської діяльності Кейс. Побудова системи статистичних показників для оцінювання ефективності банківської діяльності	Виконання практичних завдань	1,0
	<i>Самостійна робота</i>			

	<i>Самостійна робота</i>			
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; підготовка до модульних контрольних робіт; виконання індивідуального завдання		
Тема 13. Статистика ризиків діяльності та стійкості банку	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекція	Лекція. Статистика ризиків діяльності та стійкості банку	Активна робота на лекції	1,0
	Лабораторне заняття	Лабораторна робота. Візуалізація показників банківської статистики в Power BI	Виконання практичних завдань	4,0
	Практичне заняття	Практичне заняття. Статистика ризиків діяльності та стійкості банку Кейс. Виявлення банків з підвищеним ризиком	Виконання практичних завдань	1,0
	<i>Самостійна робота</i>			
	Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; оформлення звіту з лабораторної роботи; виконання індивідуального завдання		
Тема 14 Статистичне забезпечення банківського маркетингу	<i>Аудиторна робота</i>			
	Лекція	Лекція. Статистичне забезпечення банківського маркетингу	Активна робота на лекції	1,0
			Модульна контрольна робота	8,0
	Практичні заняття	Практичне заняття. Статистичне забезпечення банківського маркетингу	Виконання практичних завдань	0,5
			Виконання завдань підсумкової контрольної роботи	Підсумкова контрольна робота 40,0
	<i>Самостійна робота</i>			
Питання та завдання до самостійного опрацювання	Вивчення теоретичного матеріалу; виконання завдань на самостійне опрацювання згідно з методичними рекомендаціями; підготовка до модульної та підсумкової контрольних робіт; виконання індивідуального завдання	Захист індивідуального завдання	4,0	

Рекомендована література

Основна

1. Белова І. В. Банківська статистика : навч. посіб. / І. В. Белова. – Суми : Університетська книга, 2013. – 431 с.
2. Вашків П. Г. Фінансово-банківська статистика : навч. посіб. / П. Г. Вашків, П. І. Пастер, В. П. Сторожук, Є. І. Ткач. – Київ : Либідь, 2007. – 512 с.
3. Головач А. В. Статистика банківської діяльності : навч. посіб. / А. В. Головач, В. Б. Захожай, К. С. Базилевич. – Київ : МАУП, 1999. – 176 с.
4. Сидорова А. В. Банківська статистика : навч. посіб. / А. В. Сидорова, Н. О. Юріна. – Донецьк : Каштан, 2006. – 188 с.

Додаткова

5. Банківська статистика: навч.-метод. посібник для самост. вивч. дисц. / А. В. Головач, В. Б. Захожай, Н. А. Головач, Г. Г. Трофімова. – Київ : КНЕУ, 2003. – 161 с.
6. Губарева І. О. Банківська статистика : конспект лекцій / І. О. Губарева, Ю. В. Прохорова. – Харків : Вид. ХНЕУ, 2009. – 103 с.
7. Орлов А. И. Прикладная статистика / А. И. Орлов. – Москва : Изд. Экзамен, 2004. – 656 с.
8. Данілов В. Я. Статистична обробка даних : навч. посіб / В. Я. Данілов. – Київ : КНУ ім. Тараса Шевченка, 2019. – 156 с.
9. Кремень В.М. Фінансова статистика : навч. посіб. / В. М. Кремень, О. І. Кремень. – Київ : «Центр учбової літератури», 2014. – 368 с.
10. Лугінін О.Є. Статистика : підручник / О.Є. Лугінін. – Київ : Центр учбової літератури, 2007. – 608 с.
11. Мальчик М. В. Фінансова статистика : навч. посіб. / М. В. Мальчик., С. І. Галашко, А. І. Пелех– Київ : Центр учбової літератури, 2011. – 184 с.
12. Маслій В. В. Фінансова статистика : навч. посіб. / В. В. Маслій. – Тернопіль : Карт-бланш, 2007. – 298 с.
13. Серова І. А.. Організація статистичних спостережень : конспект лекцій / І. А. Серова, А. В. Аксьонова. – Харків : ХНЕУ, 2008. – 236 с.
14. Теорія статистики : навч. посіб. / П. Г. Вашків, П. І. Пастер, І. П. Сторожук, Є. І. Ткач. – 2-ге вид., стереотип. – Київ : Либідь, 2004. – 320с.
15. Фінансово-банківська статистика. Практикум : навч. посіб. / П.Г.Вашків, П.І.Пастер, В.П.Сторожук, Є.І.Ткач; За ред. Є.І.Ткача. – Київ : Либідь, 2002.- 324 с.

Інформаційні ресурси

16. Національний банк України. Статистика [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <https://bank.gov.ua/ua/statistic>.
17. Monetary and Financial Statistics Manual and Compilation Guide, 2016 // International Monetary Fund 2016 454p. https://bank.gov.ua/admin_uploads/article/mfsmcg_merged-web.pdf.
18. Manual on MFI Interest Rate Statistics, January 2017 // European Central Bank [Electronic resource]. – Mode of access : https://www.ecb.europa.eu/pub/pdf/other/manualonmfiinterestrate_statistics_201701.en.pdf?3d899b3c2934dab0196e6fbc3d38f984.
19. Manual on MFI balance sheet statistics January, 2019 // European Central Bank [Electronic resource]. – Mode of access : <https://www.ecb.europa.eu/pub/pdf/other/ecb.manualmfibalancesheetstatistics201901~d2ebf72987.en.pdf>.
20. Статистика банківських процесів. Сайт ПНС ХНЕУ ім. С.Кузнеця [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <https://pns.hneu.edu.ua/enrol/index.php?id=5482>.