

Trường Chính sách Công và Quản lý Fulbright
Năm học 2017-2019
Học kỳ Xuân 2018
Thời gian học: 26/02 – 08/06/2018

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC
Kinh tế lượng ứng dụng
(4 tín chỉ)

Nhóm giảng dạy

Giảng viên:	Cao Hào Thi	(thi.cao@fuv.edu.vn)
	Lê Việt Phú	(phu.le@fuv.edu.vn)
Thỉnh giảng:	Trương Sĩ Ánh	(anh.truong@kantarmedia.com)
Trợ giảng:	Hoàng Văn Thắng	(thang.hoang@fuv.edu.vn)

Giờ học

Thứ Hai và Thứ Tư: 15:15 - 16:45

Giờ trực văn phòng

Cao Hào Thi:	Thứ Tư 16:45 – 18:00 hoặc gửi email hẹn.
Lê Việt Phú:	Thứ Sáu 15:30 – 17:00 hoặc gửi email hẹn.
Hoàng Văn Thắng:	Thứ Tư và Thứ Sáu 15:30 – 17:00 hoặc gửi email hẹn.

Mục tiêu của môn học

Môn học này được thiết kế nhằm cung cấp cho học viên các kiến thức cao cấp về các mô hình định lượng và phương pháp điều tra phỏng vấn nhằm phục vụ cho việc nghiên cứu có sử dụng số liệu điều tra. Sau khóa học, học viên được kỳ vọng có khả năng:

- Đọc hiểu các nghiên cứu thực nghiệm được thực hiện bởi các nhà nghiên cứu kinh tế và phân tích chính sách;
- Phản biện các báo cáo nghiên cứu, đánh giá mức độ tin cậy của kết quả;
- Sử dụng thành thạo dữ liệu thời gian và dữ liệu bảng trong các nghiên cứu thực nghiệm;
- Xây dựng phương án điều tra và thu thập thông tin cần thiết cho một nghiên cứu định lượng;
- Tự thiết kế và xây dựng mô hình nghiên cứu sử dụng các công cụ định lượng vững chắc.

Mô tả môn học

Môn học kinh tế lượng ứng dụng được cấu trúc thành ba phần. **Trong phần đầu**, học viên sẽ ôn lại các khái niệm liên quan đến mô hình hồi quy tuyến tính cổ điển và tìm hiểu các vấn đề xảy ra khi vi phạm các giả định, bao gồm vấn đề đa cộng tuyến, vấn đề phương sai thay đổi, và tự tương quan. Sau đó, môn học sẽ giới thiệu các mô hình sử dụng dữ liệu chuỗi thời gian, bao gồm các mô hình ARIMA, mô hình VAR, và các ứng dụng trong dự báo. Học viên cũng sẽ nhận diện được các vấn đề xảy ra khi sử dụng dữ liệu chuỗi thời gian, chẳng hạn như tính không dừng, quan hệ nhân quả ngược, và hồi quy giả. Học viên sẽ thực hành các bài tập sử dụng phần mềm EViews.

Trong phần thứ hai, môn học sẽ giới thiệu các mô hình phức tạp hơn được phát triển từ lý thuyết hồi quy tuyến tính cổ điển. Việc áp đặt các điều kiện khắt khe trong mô hình hồi quy cổ điển dẫn đến khả năng áp dụng trong các nghiên cứu thực tế bị hạn chế. Do đó, nội dung phần hai chủ yếu xoay quanh các mô hình và kỹ thuật xử lý để cho phép ước lượng các bài toán dựa trên số liệu thực khi các điều kiện tiêu chuẩn không được đảm bảo. Học viên sẽ nhận diện được tính ưu việt của việc sử dụng dữ liệu bảng so với các phương pháp hồi quy dữ liệu chéo. Phương pháp hồi quy hai giai đoạn và mô hình hệ phương trình đồng thời cho phép ước lượng các bài toán khi một trong các biến giải thích không còn là ngẫu nhiên. Phương pháp hồi quy với biến phụ thuộc bị giới hạn hoặc dữ liệu bị kiểm duyệt dẫn đến ước lượng bị chệch, và hình thức xử lý. Học viên sẽ thực hành ứng dụng và mô phỏng lại các nghiên cứu sử dụng phần mềm Stata.

Trong phần cuối cùng của môn học, học viên sẽ được giới thiệu một cách khái quát về phương pháp điều tra khảo sát (survey method). Trong phần này, học viên sẽ được giới thiệu các nghiệp vụ căn bản liên quan đến quy trình thực hiện một cuộc khảo sát trong thực tiễn, từ khâu thiết kế khảo sát, thực hiện khảo sát cho đến khâu xử lý dữ liệu và báo cáo kết quả nghiên cứu khảo sát. Để có thể nắm bắt được tốt những nội dung này, học viên cần phải có những kiến thức căn bản về khoa học thống kê và lý thuyết chọn mẫu - nền tảng của tất cả các nghiên cứu thực nghiệm (empirical research). Vì vậy khóa học này sẽ dành một phần thời gian để giới thiệu một số kiến thức thống kê căn bản có liên quan đến lý thuyết chọn mẫu và các phương pháp chọn mẫu. Đồng thời học viên cũng sẽ được giới thiệu một số CSDL của Tổng Cục Thống Kê thường được sử dụng làm cơ sở cho nhiều phân tích, nghiên cứu khác ở Việt Nam. Trong bài giảng cuối cùng, học viên sẽ được tiếp cận và thực hành với một bộ dữ liệu thực với phần mềm SPSS.

Các yêu cầu của môn học

Học viên được yêu cầu tham gia lớp đầy đủ, đọc các bài giảng và tài liệu trước khi đến lớp. Trong môn học này, học viên phải hoàn tất các bài tập, một bài thi giữa kỳ, và bài thi thực hành cuối kỳ. Học viên luôn được khuyến khích tự thành lập các nhóm để thảo luận về bài giảng, các tình huống, và học tập cùng nhau. Tuy nhiên, mỗi học viên phải tự mình hoàn thành các bài tập một cách độc lập tuyệt đối. Môn học sẽ yêu cầu học viên sử dụng các phần mềm chuyên dụng như Eviews, Stata, và SPSS để thực hành lại các ví dụ trong sách và các bài nghiên cứu.

Đây là môn học tùy chọn. Tuy nhiên các học viên dự định sử dụng phương pháp định lượng để làm luận văn thạc sỹ được yêu cầu học môn học này. Môn Kinh tế lượng ứng dụng là một chủ đề đầy thách thức cho học viên. Vì thế, nếu anh/chị gặp phải bất kỳ vấn đề khó khăn nào hay có câu hỏi gì, thì hãy nhờ ban giảng viên giúp đỡ càng sớm càng tốt.

Điểm đánh giá

Bài tập	40%
Thi giữa kỳ	30%
Bài thi cuối kỳ	30%

Tất cả bài tập và bài thi đều có hạn nộp là 08:20, áp dụng cho cả bản in lẫn bản điện tử, trừ khi có hướng dẫn khác. ***Các quy định về nộp bài, khiếu nại, đạo văn, gian lận trong làm bài và thi cử, hay các trường hợp đặc biệt được quy định trong Sổ tay học viên đã phát.***

Tài liệu đọc bắt buộc

Sách giáo khoa chính: Các bài giảng sẽ được rút ra hầu hết từ hai cuốn sách giáo khoa, cả hai cuốn này đều có bản tiếng Anh và bản tiếng Việt. Các chương cụ thể để tham khảo được ghi trong đề cương môn học. Học viên sẽ được phát tài liệu bổ sung vào những thời điểm thích hợp. Tài liệu này cũng là một phần bài đọc bắt buộc.

1. *Kinh tế lượng cơ sở*, ấn bản thứ ba, của Damodar Gujarati, Nhà Xuất bản McGraw-Hill, 1995. [Ký hiệu: DG3]
2. *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 5th edition của Jeffrey M. Wooldridge, Nhà xuất bản South-Western. Học viên có thể tham khảo dữ liệu và mã chương trình STATA để mô phỏng lại các kết quả thực hiện trong sách tại: <http://fmwww.bc.edu/gstat/examples/wooldridge/wooldridge.html>. [Ký hiệu: JW]

Một số tài liệu tham khảo khác

3. *Nhập môn kinh tế lượng với các ứng dụng*, ấn bản thứ năm, của Ramu Ramanathan, Nhà Xuất bản Harcourt College, 2002. Cuốn sách giáo khoa này được chọn vì nó có định hướng ứng dụng mạnh mẽ và thể hiện rõ ràng thực tiễn kinh tế lượng hiện đại. Cuốn sách này có website rất hay là: <http://econ.ucsd.edu/~rramanat/embook5.htm>.
4. *Thiết kế nghiên cứu: Phương pháp định tính, định lượng và hỗn hợp (Research Design: Qualitative, Quantitative, và Mixed Methods Approaches)*, của John Creswell, tái bản lần thứ 2. Sage Publications.

Các trường hợp ứng dụng: Nhiều trường hợp ứng dụng và thí dụ minh họa sẽ được chỉ định và/hoặc thảo luận trong lớp vào những thời điểm thích hợp. Mục đích là để giúp anh/chị làm quen với những cách khác nhau mà các kỹ thuật kinh tế lượng đã được sử dụng để nghiên cứu những vấn đề khó khăn của "thế giới thực" và các vấn đề về chính sách. Các trường hợp ứng dụng này sẽ được rút ra từ các cuốn sách giáo khoa chính cộng với các tình huống nghiên cứu từ thực tiễn của Việt Nam.

Lịch học

Tuần 1

- Thứ Hai 26/02/2018 Cao Hào Thi

Nói lỏng các giả định của mô hình hồi quy tuyến tính cổ điển: Đa cộng tuyến, cỡ mẫu nhỏ, và phương sai thay đổi

Tài liệu đọc: DG3 Chương 10-11

Phát Bài tập 1

- Thứ Tư 28/02/2018 Cao Hào Thi

Nói lỏng các giả định của mô hình hồi quy tuyến tính cổ điển: Thực hành sử dụng phần mềm EViews

Tài liệu đọc: DG3 Chương 10-11

Tuần 2

- Thứ Hai 05/03/2018 Cao Hào Thi

Nói lỏng các giả định của mô hình hồi quy tuyến tính cổ điển: Tự tương quan

Tài liệu đọc: DG3 Chương 12

- Thứ Tư 07/03/2018 Cao Hào Thi

Phân tích số liệu chuỗi thời gian – 1

DG3: Chương 21-22

Tuần 3

- Thứ Hai 12/03/2018 Cao Hào Thi

Phân tích số liệu chuỗi thời gian – 2

Tài liệu đọc: DG3 Chương 21-22

Nộp Bài tập 1/Phát Bài tập 2

- Thứ Tư 14/03/2018 Cao Hào Thi

Nghiên cứu tình huống: Sử dụng EViews ước lượng mô hình ARIMA để dự báo giá cả và giá chứng khoán

Tuần 4

Thứ Hai 19/03/2018

Cao Hào Thi

Hội quy giả

Tài liệu đọc: DG3 Chương 21

Thứ Tư 21/03/2018

Cao Hào Thi

Các mô hình kinh tế lượng động và kiểm định nhân quả Granger

Tài liệu đọc: DG3 Chương 17

Tuần 5

Thứ Hai 26/03/2018

Lê Việt Phú

Hội quy với dữ liệu gộp và dữ liệu bảng - 1

Tài liệu đọc: JW Chương 13-14

Nộp Bài tập 2/Phát Bài tập 3

Thứ Tư 28/03/2018

Lê Việt Phú

Hội quy với dữ liệu gộp và dữ liệu bảng - 2

Tài liệu đọc: JW Chương 13-14

Tuần 6

Ôn tập, không lên lớp

Tuần 7

Thứ hai 09/04/2018

Cao Hào Thi, Lê Việt Phú, Hoàng Văn Thắng

Thi giữa kỳ

Tuần 8

Thứ Hai 16/04/2018

Lê Việt Phú

Hồi quy hai giai đoạn (2SLS) - 1

Tài liệu đọc: JW Chương 15

Nộp Bài tập 3/Phát Bài tập 4

Tuần 9

Thứ Hai 23/04/2018

Lê Việt Phú

Hồi quy hai giai đoạn (2SLS) - 2

Tài liệu đọc: JW Chương 15

Thứ Sáu 27/04/2018

Lê Việt Phú

Hệ phương trình hồi quy (SEM) - 1

Tài liệu đọc: JW Chương 16

Nộp Bài tập 4/Phát Bài tập 5

Tuần 10

Thứ Tư 02/05/2018

Lê Việt Phú

Hệ phương trình hồi quy (SEM) - 2

Tài liệu đọc: JW Chương 16

Tuần 11

Thứ Hai 07/05/2018

Lê Việt Phú

Hồi quy với biến phụ thuộc bị giới hạn và vấn đề tự lựa chọn mẫu - 1

Tài liệu đọc: JW Chương 17

Nộp Bài tập 5/Phát Bài tập 6

Thứ Tư 09/05/2018

Lê Việt Phú

Hồi quy với biến phụ thuộc bị giới hạn và vấn đề tự lựa chọn mẫu - 2

Tài liệu đọc: JW Chương 17

Tuần 12

- Thứ Hai 14/05/2018 Trương Sĩ Ánh

Phương pháp khảo sát: Lập kế hoạch và chọn mẫu nghiên cứu

Nộp Bài tập 6

- Thứ Tư 16/05/2018 Trương Sĩ Ánh

Phương pháp khảo sát: Chọn mẫu nghiên cứu (tiếp)

Tuần 13

- Thứ Hai 21/05/2018 Trương Sĩ Ánh

Phương pháp khảo sát: Tiến hành khảo sát thu thập dữ liệu từ thực địa

- Thứ Tư 23/05/2018 Trương Sĩ Ánh

Phương pháp khảo sát: Phân tích kết quả khảo sát bằng phần mềm SPSS

Tuần 14

- Ôn tập, không lên lớp
-

Tuần 15

- Thứ Hai 04/06/2018

Phát Bài thi cuối môn (Hạn nộp bài ngày 15/06/2018)
