|  |  |
| --- | --- |
| BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO **TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG**\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |  |
| **ĐỀ CƯƠNG HỌC PHẦN** |
|  |
| **1.** | **Thông tin học phần:** |
|  | **Tên học phần:** | **KINH TẾ LƯỢNG ỨNG DỤNG****Applied Econometrics** |
|  | **Mã số:** | EC503 |
|  | **Thời lượng:** | 3(2-1) |
|  | **Loại:** | Bắt buộc |
|  | **Trình độ đào tạo:** | Thạc sĩ |
|  | **Đáp ứng CĐR:** | 1, 2, 4, 5 |
|  | **Học phần tiên quyết:** | EC505, EC506, ECS511 |
|  | **Giảng viên biên soạn:** | TS. Phạm Thành Thái |
|  | **Bộ môn quản lý:** | Kinh tế học |
| **2.** | **Mô tả:** |
|  | Nội dung chính của học phần bao gồm: Thứ nhất, giới thiệu các vấn đề nảy sinh trong việc ước lượng một mô hình khi các giả thiết của mô hình hồi qui tuyến tính cổ điển (CLRM) bị vi phạm và các phương pháp khắc phục. Thứ hai, học viên sẽ được tiếp cận việc ước lượng mô hình với số liệu theo chuỗi thời gian và số liệu bảng. Thứ ba, các mô hình với biến phụ thuộc định tính và bị giới hạn cũng được nghiên cứu ở học phần này. |
| **3.** | **Mục tiêu:** |
|  | Học phần này nhằm mục đích cung cấp cho học viên (1) Khả năng đọc hiểu các nghiên cứu thực nghiệm được thực hiện bởi các nhà nghiên cứu kinh tế; (2) Khả năng phân tích có tính phê phán đối với các nghiên cứu định lượng được thực hiện bởi các tác giả khác và sử dụng các phân tích này vào việc thiết kế chính sách; và (3) Nó còn nhằm cung cấp cho học viên các kỹ năng cần thiết để học viên có thể tự thực hiện một nghiên cứu định lượng về các chính sách. |
| **4.** | **Kết quả học tập mong đợi:** |
|  | Sau khi học xong học phần, học viên có thể: |
| 1) | Nắm vững nội dung các mô hình kinh tế lượng được ứng dụng phổ biến trong thực tế. |
| 2) | Lựa chọn được mô hình kinh tế lượng phù hợp với chủ đề nghiên cứu thực tiễn. |
| 3) | Sử dụng thành thạo các phần mềm kinh tế lượng (EVIEWS, STATA, SPSS,…) |
| **5.** | **Nội dung:** |
| **TT** | **Chủ đề** | **Nhằm đạt KQHT** | **Số tiết** |
| **LT** | **TH** |
| 11.11.21.31.41.51.61.71.8 | **Chuyên đề 1:** Ôn tập kinh tế lượng căn bản.Mô hình hồi quy tuyến tínhBản chất và nguồn dữ liệuƯớc lượng mô hình hồi quy tuyến tínhMô hình hồi quy tuyến tính cổ điển (CLRM)Phương sai và sai số chuẩn của các ước lượng OLSKiểm định giả thuyết cho các hệ số hồi quy tổng thểR2: Đo lường độ thích hợp của hàm hồi quy ước lượngVí dụ minh họa | 1, 2, 3 | 2 | 1 |
| 22.12.22.32.42.52.62.72.82.9 | **Chuyên đề 2:** Dạng hàm của các mô hình hồi quy.Hàm Log-linear (double-log)Hàm Log-lin (Mô hình tăng trưởng)Hàm Lin-logHàm nghịch đảoCác mô hình hồi quy đa thứcLựa chọn dạng hàmSo sánh mô hình tuyến tính và log képHồi với với các biến chuẩn hóaĐo lường độ thích hợp của mô hình | 1, 2, 3 | 2 | 1 |
| 33.13.2 | **Chuyên đề 3:** Các mô hình hồi quy với biến độc lập định tính.Những vấn đề cơ bản về biến độc lập định tínhCác ví dụ minh họa | 1, 2, 3 | 2 | 2 |
| 44.14.24.34.4 | **Chuyên đề 4:** Chuẩn đoán mô hình: Đa cộng tuyến; Phương sai thay đổi; Tự tương quan; Các sai số đặc trưng mô hình.Đa cộng tuyến trong kinh tế lượngPhương sai của sai số thay đổiTự tương quanCác sai lầm nhận dạng mô hình | 1, 2, 3 | 10 | 5 |
| 55.15.2 | **Chuyên đề 5:** Mô hình Tobit và các mô hình chọn lựa (Selection models) Mô hình Logit và ProbitCác mô hình với biến phụ thuộc bị giới hạn | 1, 2, 3 | 5 | 2 |
| 66.16.26.36.46.5 | **Chuyên đề 6:** Mô hình dữ liệu bảng (Panel data).Tầm quan trọng của dữ liệu dạng bảngMô hình những tác động cố định (FEM)Mô hình những tác động ngẫu nhiên (ECM hay REM)So sánh giữa FEM và ECM | 1, 2, 3 | 4 | 2 |
| 77.17.2 | **Chuyên đề 7:** Mô hình chuỗi thời gian.Chuỗi thời gian dừng và không dừngĐồng liên kết và các mô hình hiệu chỉnh sai số | 1, 2, 3 | 5 | 2 |
| **6.** | **Học liệu:** |
| 1) | Wooldridge, J. M. (2006). Introductory Econometrics: A Modern Approach. |
| 2) | Gujarati, D. (2011), Econometrics by Example. |
| 3) | Ramanathan, R. (2002), Introductory Econometrics with applications. |
| 4) | Carter H. R. & et al. (2008). Principles of Econometrics. |
| **7.** | **Kiểm tra và Đánh giá:** |
| **TT** | **Hình thức kiểm tra, đánh giá** | **Nhằm đạt KQHT** | **Trọng số (**%) |
| 1. | Kiểm tra thường xuyên (lớp < 15 HV), (vấn đáp)Hoặc kiểm tra giữa kỳ (lớp > 15 HV), (viết) | 1 | 10 |
| 2. | Tiểu luận (viết) | 1, 2, 3 | 20 |
| 3. | Thi kết thúc học phần (viết) | 1, 2, 3 | 70 |
|  |
| **Giảng viên biên soạn:** |
| **Họ và tên** | **Chức danh, học vị** | **Chữ ký** |
| Phạm Thành Thái | Tiến sĩ |  |
| **Ngày cập nhật cuối cùng: / 3 /2018** |

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_