

Chương trình Giảng dạy Kinh tế Fulbright
Thạc sỹ Chính sách Công MPP7
Năm học 2014-2015
Học kỳ Xuân 2015
Thời gian học: 07/04 – 20/05/2015

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC
Kinh tế lượng ứng dụng

Nhóm giảng dạy

Giảng viên: Đình Công Khải, Cao Hào Thi, và Lê Việt Phú
Trợ giảng: Nguyễn Thị Thúy Loan

Giờ học

Thứ Hai và Thứ Tư: 15:15 - 16:45

Giờ trực văn phòng

Đình Công Khải: Thứ Sáu 13:00 – 15:00 hoặc gửi email hẹn
Cao Hào Thi: Thứ Hai 16:45 – 18:00 hoặc gửi email hẹn
Lê Việt Phú: Thứ Ba và Thứ Năm 15:30 – 17:00 hoặc gửi email hẹn.
Nguyễn Thị Thúy Loan: Thứ Hai 17:00-18:00 và Thứ Tư 17:00-19:00

Mục tiêu và mô tả môn học

Môn học này nhằm mục đích cung cấp cho học viên khả năng đọc hiểu các nghiên cứu thực nghiệm được thực hiện bởi các nhà nghiên cứu kinh tế. Ngoài ra, 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.

Môn học này được thiết kế nhằm trình bày các kỹ thuật kinh tế lượng cao cấp trong hai phần. Phần đầu tiên của môn học học viên sẽ trình bày cho các học viên 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. Tiếp theo, học viên sẽ được tiếp cận việc ước lượng mô hình với số liệu theo chuỗi thời gian và số liệu bảng; đây là công cụ được sử dụng rất phổ biến hiện nay trong các nghiên cứu thực nghiệm về kinh tế. Ngoài ra, học viên còn được cung cấp các kỹ thuật hữu dụng khác trong kinh tế lượng như hồi qui đồng kết hợp, mô hình kinh tế lượng động và kiểm định nhân quả Granger để có thể nghiên cứu các câu hỏi chính sách khác nhau.

Phần thứ hai tập trung vào ứng dụng mô hình kinh tế lượng để đánh giá tác động nhân quả của chính sách can thiệp lên các nhân tố kinh tế xã hội. Thách thức lớn nhất đối với các nhà hoạch định kinh tế là làm thế nào để biết một chính sách đã ban hành có tác dụng đến đâu. Ví dụ chương trình phát triển kinh tế xã hội các xã đặc biệt khó khăn vùng dân tộc thiểu số và miền núi (Chương trình 135) có tác động như thế nào đến tỷ lệ nghèo đói và cuộc sống của người dân

vùng được hỗ trợ. Một ví dụ khác là chương trình tín dụng nhỏ của ngân hàng chính sách xã hội có đến được với người thực sự cần giúp đỡ không. Biến nội sinh và lựa chọn mẫu là hai vấn đề thường xuyên gặp phải trong các nghiên cứu đánh giá chính sách, và sẽ làm sai lệch kết quả trong các mô hình hồi quy thông thường. Do vậy các nhà nghiên cứu cần xử lý các vấn đề trên bằng cách thiết kế mô hình nghiên cứu thật chặt chẽ nhằm bóc tách được tác động của chính sách ra khỏi các yếu tố gây nhiễu khác. Trong môn học này học viên sẽ làm quen với các khái niệm và mô hình sử dụng trong đánh giá tác động của chính sách như khái niệm ngẫu nhiên hóa, mô hình so sánh bằng điểm xu hướng, mô hình khác biệt kép, mô hình biến công cụ, và mô hình hồi quy gián đoạn.

Các yêu cầu của môn học

Đây là môn học tùy chọn. Tuy nhiên Chương trình khuyến khích các học viên dự định sử dụng phương pháp định lượng để làm luận văn thạc sĩ đăng ký học môn học này.

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 5 bài tập và một bài thi cuối môn học.

Học viên luôn được khuyến khích tự thành lập các nhóm học tập 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 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 huấn giúp đỡ càng sớm càng tốt.

Môn học sẽ yêu cầu học viên sử dụng các phần mềm chuyên dụng như Eviews hoặc Stata để thực hành lại các ví dụ trong sách.

Điểm đánh giá

Thảo luận	15%
Bài tập	45%
Bài thi cuối môn	40%

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. Bản in nộp tại Phòng Vi tính, bản điện tử gửi đến địa chỉ email <http://intranet.fetp.edu.vn:81/>

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. *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>. Ký hiệu: RR5
2. *Kinh tế lượng cơ sở*, ấn bản thứ ba, của Damodar Gujarati, Nhà Xuất bản McGraw-Hill, 1995. Ký hiệu: DG3

3. *Kinh tế lượng cơ sở*, ấn bản thứ tư, của Damodar Gujarati, Nhà Xuất bản McGraw-Hill, 2004. Cuốn sách này có một website hữu ích ở:
<http://www.mhhe.com/econometrics/gujarati4> (Xin lưu ý website này gắn kết với ấn bản lần thứ tư của cuốn sách này). Ký hiệu: DG4
4. *Sổ tay đánh giá tác động: phương pháp định lượng và thực hành*, của Shahidur R. Khandker, Gayatri B. Koolwal, and Hussain A. Samad, 2010. The International Bank for Reconstruction and Development / The World Bank, Washington DC 20433, ISBN: 978-0-8213-8028-4 (Ký hiệu: KKS)

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 06/04/2015

Cao Hào Thi

Nói lỏng các giả định của mô hình cổ điển I: Đa cộng tuyến và cỡ mẫu nhỏ

DG3: Chương 10

Phát Bài tập 1 – Hạn nộp 20/04/2015

☐ Thứ Ba 07/04/2015 (13:30 – 15:00)

Đình Công Khải

Nói lỏng các giả định của mô hình cổ điển II: Phương sai thay đổi

DG3: Chương 11

Tuần 2

☐ Thứ Hai 13/04/2015 (13:30 – 15:00)

Đình Công Khải

Nói lỏng các giả định của mô hình cổ điển III: Tự tương quan

DG3: Chương 12

☐ Thứ Tư 15/04/2015 (13:30 – 15:00)

Cao Hào Thi

Phân tích số liệu chuỗi thời gian I

DG3: Chương 21 và 22

Tuần 3

☐ Thứ Hai 20/04/2015

Cao Hào Thi

Phân tích số liệu chuỗi thời gian II

Nghiên cứu tình huống: Ứng dụng mô hình ARIMA để dự báo giá cả và giá chứng khoán

DG3: Chương 21 và 22

Nộp Bài tập 1; Phát Bài tập 2 – hạn nộp 04/05/2015

☐ Thứ Tư 22/04/2015

Đinh Công Khải

Hồi quy giả

DG3: Chương 21

Tuần 4

☐ Thứ Hai 27/04/2015

Nghỉ

☐ Thứ Tư 29/04/2015

Nghỉ

Tuần 5

☐ Thứ Hai 04/05/2015

Đinh Công Khải

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

DG4: Chương 17

Nộp Bài tập 2; Phát Bài tập 3 – hạn nộp 11/05/2015

☐ Thứ Tư 06/05/2015

Đinh Công Khải

Phân tích số liệu bảng

DG4, Chương 16

Tuần 6

❑ Thứ Hai 11/05/2015

Lê Việt Phú

Giới thiệu về đánh giá tác động chính sách
KKS, Chương 2 và 3

Nộp Bài tập 3; Phát Bài tập 4 – hạn nộp 18/05/2015

❑ Thứ Tư 13/05/2015

Lê Việt Phú

Mô hình so sánh bằng điểm xu hướng

KKS, Chương 4

WB, Evaluating the Impact of Development Projects on Poverty: A Handbook for Practitioners, 2002, Chương 3 (tham khảo thêm)

Tuần 7

❑ Thứ Hai 18/05/2015

Lê Việt Phú

Mô hình khác biệt kép

KKS, Chương 5

Nộp Bài tập 4; Phát Bài tập 5 – hạn nộp 25/05/2015

❑ Thứ Tư 20/05/2015

Lê Việt Phú

Mô hình biến công cụ và hồi quy gián đoạn

KKS, Chương 6 and 7

RR5, Chương 13

Tuần 8

❑ Thứ Hai 25/05/2015

Nộp Bài tập 5

❑ Thứ Tư 27/05/2015

Đinh Công Khải, Cao Hào Thi, Lê Việt Phú

Phát bài thi cuối môn– nộp vào ngày 10/06/2015