

Chương trình Giảng dạy Kinh tế Fulbright
Thạc sỹ Chính sách công 5
Năm học 2012-2014
Học kỳ Xuân 2013
Thời gian học: 15/04 – 29/05/2013

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC
Kinh tế lượng ứng dụng

Nhóm giảng viên

Giảng viên: Đinh Công Khải và Cao Hào Thi

Giờ học

Thứ Hai và Thứ Tư: 15:15 - 16:45

Giờ trực văn phòng

Đinh Công Khải: Thứ Năm 16:00 – 18:00 hoặc gửi email hẹn

Cao Hào Thi: Thứ Năm 16:45 – 18:45 hoặc gửi email hẹn

Mục tiêu và mô tả môn học

Môn học này nhằm mục đích cung cấp cho sinh 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 sinh viên các kỹ năng cần thiết để sinh viên có thể tự thực hiện một nghiên cứu định lượng về các chính sách.

Môn học này chú trọng giảng dạy các kỹ thuật kinh tế lượng cao cấp. Đầu tiên, môn học giới thiệu cho sinh 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. Học viên cũng sẽ được giới thiệu các biến công cụ được dùng để xử lý vấn đề nội sinh (endogeneity) trong việc ước lượng một mô hình. Thứ hai, sinh 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, sinh viên còn được cung cấp các kỹ thuật hữu dụng khác trong kinh tế lượng như phương pháp khác biệt trong khác biệt, hồi qui đồng kết hợp, kiểm định nhân quả Granger, và dự báo để có thể nghiên cứu các câu hỏi chính sách khác nhau.

Các yêu cầu của môn học

Đây là môn học tùy chọn. Chương trình khuyến khích các học viên dự định sử dụng phương pháp định lượng để làm luận văn thạc sỹ đăng ký học môn học này. Sau buổi học đầu tiên, các học viên sẽ đăng ký học chính thức với hạn chót đăng ký là 12:00 giờ trưa, ngày 16/4/2013. Các

học viên không đăng ký học sẽ không được dự thính và bảng điểm MPP sẽ không có môn học này. Các học viên đăng ký học có trách nhiệm thực hiện các yêu cầu dưới đây và kết quả học tập sẽ được ghi trong bảng điểm MPP

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 3 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 sẽ dụng các phần mềm chuyên dụng như Eviews, SPSS, 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 13:20, 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>.

Kết quả môn học của học viên được đánh giá là “Đạt” nếu điểm tổng kết môn học là B- trở lên.

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 khóa 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 thứ bốn của cuốn sách này). Ký hiệu: DG4

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 điều nghiên 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 hai cuốn sách giáo khoa chính cộng với các tình huống nghiên cứu từ thực tiễn của Việt Nam.

Lịch học

Tuần 1

- Thứ Hai 15/04/2013 **Cao Hào Thi**
Ôn tập Kinh tế lượng căn bản

- Thứ Tư 17/04/2013
Nghỉ

Tuần 2

- Thứ Hai 22/04/2013 **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 06/05/2013

- Thứ Tư 24/04/2013 **Đình Công Khải**
Nói lỏng các giả định của mô hình cổ điển II:
Phương sai thay đổi

DG3: Chương 11

Tuần 3

- Thứ Hai 29/04/2013
Nghỉ

- Thứ Tư 02/05/2013 **Đình Công Khải**
Nói lỏng các giả định của mô hình cổ điển III:
Tương quan chuỗi

- DG3: Chương 12

Tuần 4

Thứ Hai 06/05/2013

Cao Hào Thi

Phân tích số liệu chuỗi thời gian I

- DG3: Chương 21 và 22

Nộp bài tập 1; Phát bài tập 2 – hạn nộp 20/05/2013

Thứ Tư 08/05/2013

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 and 22

Tuần 5

Thứ Hai 13/05/2013

Đình Công Khải

Hồi quy giả

- DG3: Chương 21

Thứ Tư 15/05/2013

Đình Công Khải

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

- DG4: Chương 17

Tuần 6

Thứ Hai 20/05/2013

Đình Công Khải

Phân tích số liệu bảng

- DG4, Chương 16

Nộp bài tập 2; Phát bài tập 3 – hạn nộp 03/06/2013

Thứ Tư 22/05/2013

Nguyễn Xuân Thành

Phương pháp khác biệt trong khác biệt

- Ngân hàng Thế giới, Đánh giá tác động của các dự án phát triển tới đối nghèo: Sổ tay danh cho cán bộ thực hành, 2002, Chương 3.

- Nguyễn Xuân Thành, Ước lượng suất sinh lợi của việc đi học ở Việt Nam: Phương pháp khác biệt trong khác biệt, tháng 11 năm 2006, Bài viết nghiên cứu FETP.

Tuần 7

Thứ Hai 27/05/2013

Cao Hào Thi

Biên công cụ

- RR5, Chương 13

Thứ Tư 29/05/2013

Cao Hào Thi

Dự báo

- RR5, Chương 11

Tuần 8

Thứ Hai 03/06/2013

Nộp bài tập 3

Phát bài thi cuối môn– nộp vào ngày 17/06/2013