

Chương trình Giảng dạy Kinh tế Fulbright
Thạc sỹ Chính sách Công MPP8
Năm học 2015-2016
Học kỳ Xuân 2016
Thời gian học: 11/04 – 25/05/2016

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC
Kinh tế lượng ứng dụng

Nhóm giảng dạy

Giảng viên: Đinh Công Khải, Cao Hào Thi, và Lê Việt Phú
Trợ giảng: Hoàng Văn Thắng

Giờ học

Thứ Hai và Thứ Tư: 13:30 - 15:00

Giờ trực văn phòng

Đinh Công Khải: Thứ Hai 15:00 – 17:00 hoặc gửi email hẹn.
Cao Hào Thi: Thứ Ba 17:30 – 19:00 hoặc gửi email hẹn.
Lê Việt Phú: Thứ Ba và Thứ Năm 15:30 – 17:00 hoặc gửi email hẹn.
Hoàng Văn Thắng: Thứ Tư và Thứ Sáu: 15:15 – 16:45 hoặc gửi email hẹn

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 sẽ trình bày về 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 của các 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, để từ đó đưa ra các nhận định và điều chỉnh cần thiết. Ví dụ chương trình hỗ trợ đầu tư cơ sở hạ tầng, hỗ trợ phát

triển sản xuất cho các xã đặc biệt khó khăn, xã biên giới, xã an toàn khu, các thôn, bản đặc biệt khó khăn (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 vi mô của ngân hàng chính sách xã hội có thực sự giúp đỡ đối tượng được vay vốn cải thiện chất lượng cuộc sống hay không. Trong các tình huống thực tiễn nêu trên, học viên phải nhận định được đâu là tác động do chính sách, đâu là những nhân tố có thể làm sai lệch kết quả, và phương pháp đánh giá nào có thể áp dụng được đối với các loại dữ liệu khác nhau. Trong môn học này học viên sẽ làm quen với các khái niệm và mô hình thường được 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 sử dụng dữ liệu bảng, và mô hình biến công cụ.

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 viên 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 nộp tại địa chỉ:

<http://www.fetp.edu.vn/vn/tai-nguyen/hoc-vien-hien-tai/>

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: các 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 11/04/2016 (13:30 – 15:00) 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 25/04/2016

- Thứ Ba 12/04/2016 (15:15 – 16:45) 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 18/04/2016
Nghỉ

- Thứ Tư 20/04/2016 (13:30 – 15:00) Đình Công Khải
Nói lỏng các giả định của mô hình cổ điển III: Tự tương quan
DG3: Chương 12

Tuần 3

Thứ Hai 25/04/2016 (13:30 – 15:00)

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 09/05/2016

Thứ Tư 27/04/2016 (13:30 – 15:00)

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

Tuần 4

Thứ Hai 02/05/2016 (13:30 – 15:00)

Nghỉ

Thứ Tư 04/05/2016 (13:30 – 15:00)

Đình Công Khải

Hồi quy giả

DG3: Chương 21

Tuần 5

Thứ Hai 09/05/2016 (13:30 – 15:00)

Đình 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 16/05/2016

Thứ Tư 11/05/2016 (13:30 – 15:00)

Đình Công Khải

Phân tích số liệu bảng

DG4, Chương 16

Tuần 6

☐ **Thứ Hai 16/05/2016 (13:30 – 15:00)**

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 23/05/2016

☐ **Thứ Tư 18/05/2016 (13:30 – 15:00)**

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 23/05/2016 (13:30 – 15:00)**

Lê Việt Phú

Mô hình khác biệt kép

KKS, Chương 5

Nộp Bài tập 4; Phát Bài tập 5 – hạn nộp 30/05/2016

☐ **Thứ Tư 25/05/2014 (13:30 – 15:00)**

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 30/05/2016**

Nộp Bài tập 5

Phát bài thi cuối môn– nộp vào lúc 8:20am ngày 13/06/2016