

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC

1. Thông tin chung về môn học

1.1 Tên môn học: **Kinh tế lượng** - Mã môn học: **ECON2304**

1.2 Khoa phụ trách: Khoa Kinh Tế và Luật

1.3 Số tín chỉ: 3 tín chỉ lý thuyết

2. Mô tả môn học

Môn học giới thiệu sinh viên về việc xác định và ước tính các mô hình hồi quy tuyến tính. Môn học sẽ nhấn mạnh phương pháp bình phương bé nhất (least squares – LS): cách ước tính, diễn giải kết quả hồi quy, và phân tích các vấn đề có thể ảnh hưởng đến kết quả ước tính. Sau đó, sinh viên sẽ học cách giải quyết những vấn đề này để tránh những tác động đến suy diễn thống kê. Khóa học này chủ yếu tập trung vào kinh tế lượng số liệu chéo.

3. Mục tiêu môn học

* Mục tiêu tổng quát:

Sinh viên sẽ có kiến thức và kỹ năng phân tích kinh tế lượng cơ bản, cụ thể là xác định và ước tính các mô hình hồi quy tuyến tính và kiểm định các giả thuyết về các tham số của mô hình với các giả định thống kê khác nhau.

* Mục tiêu cụ thể:

- Kiến thức:

Sinh viên sẽ

- (i) nắm vững phương pháp ước tính bình phương tối thiểu thông thường;
- (ii) diễn giải kết quả hồi quy;
- (iii) Kiểm định các mối quan hệ kinh tế lượng;
- (iv) Hiểu những trường hợp vi phạm giả định và cách giải quyết.

- Kỹ năng:

Sinh viên sẽ biết sử dụng 1 phần mềm thống kê để thực hiện các mục tiêu trên.

4. Nội dung môn học

Tên chương	Mục tiêu	Nội dung khái quát	Số tiết				Ghi chú
			TC	LT	BT	TH	
Giới thiệu	Giới thiệu nội dung	- Khái niệm kinh tế lượng	4.5	4.5	0	0	

Tên chương	Mục tiêu	Nội dung khái quát	Số tiết				Ghi chú
			TC	LT	BT	TH	
	và khái niệm cơ bản, mối liên hệ với các môn học khác	<ul style="list-style-type: none"> - Ứng dụng - Cấu trúc dữ liệu - Nghiên cứu thực nghiệm 					
Ôn tập Xác suất Thống kê	Giới thiệu biến ngẫu nhiên, phân phối xác suất, các chỉ số thống kê, phân phối mẫu, và các kiểm định	<ul style="list-style-type: none"> - Biến ngẫu nhiên và phân phối xác suất - Trung bình, phương sai, hiệp phương sai, hệ số tương quan - Lấy mẫu ngẫu nhiên và phân phối mẫu - Phân phối chi-bình phương, t, và F - Kiểm định giả thuyết 	9	9	0	0	
Hàm hồi quy đơn biến	Giới thiệu hàm hồi quy đơn biến, phương pháp ước tính OLS, các đặc điểm thống kê, kiểm định giả thuyết, và khoảng tin cậy	<ul style="list-style-type: none"> - Định nghĩa hàm hồi quy đơn biến - Phương pháp ước tính OLS - Đặc điểm thống kê của ước tính OLS - Kiểm định thống kê - Thay đổi đơn vị đo lường - Khoảng tin cậy - Quan hệ nhân quả 	9	9	0	0	
Hàm hồi quy đa biến	Giới thiệu hàm hồi quy đa biến, mức độ phù hợp và tiêu chí lựa chọn mô hình, kiểm định giả thuyết, và các sai lầm xác định mô hình	<ul style="list-style-type: none"> - Định nghĩa và sự cần thiết của hàm hồi quy đa biến - Mức độ phù hợp của mô hình - Tiêu chí lựa chọn mô hình - Kiểm định giả thuyết - Sai lầm trong xác định mô hình 	9	9	0	0	
Đa cộng tuyến	Giới thiệu về hiện tượng đa cộng tuyến	<ul style="list-style-type: none"> - Ví dụ về đa cộng tuyến - Đa cộng tuyến hoàn hảo - Đa cộng tuyến (không hoàn hảo) - Ứng dụng 	4.5	4.5	0	0	
Biến độc lập định tính (biến giả)	Giới thiệu biến giả và ứng dụng của biến này trong phân tích hồi quy	<ul style="list-style-type: none"> - Biến giả với hai nhóm - Biến giả với nhiều nhóm - Biến giả và hệ số góc - Ứng dụng trong tính mùa vụ, thay đổi cấu trúc 	4.5	4.5	0	0	

Tên chương	Mục tiêu	Nội dung khái quát	Số tiết				Ghi chú
			TC	LT	BT	TH	
Phương sai sai số thay đổi	Bàn luận về hậu quả của phương sai sai số thay đổi, kiểm định hiện tượng này, và cách ước tính	- Hậu quả của phương sai sai số thay đổi - Kiểm định phương sai sai số thay đổi - Ước tính khi có hiện tượng này	4.5	4.5	0	0	
Tổng cộng			45	45	00	00	

Ghi chú: TC: Tổng số tiết; LT: lý thuyết; BT: bài tập, thảo luận; TH: Thực hành.

5. Học liệu

5.1 Tài liệu bắt buộc

- [1] Ramanathan, Ramu (2002). Nhập môn Kinh tế lượng với các ứng dụng. Nhà xuất bản Harcourt College. (Bản dịch của chương trình Giảng dạy Kinh tế Fulbright, Việt Nam.)

5.2 Tài liệu tham khảo

- [1] Gujarati, D.N. và Porter, D.C. (2008). U. Nhà xuất bản McGraw-Hill.
- [2] Hoàng Ngọc Nhậm (2007). Giáo trình Kinh tế lượng. Trường Đại học Kinh tế TP.HCM.
- [3] Wooldridge, J.M. (2013). Introductory Econometrics: A Modern Approach. Nhà xuất bản South-Western Cengage Learning.

6. Đánh giá kết quả học tập

Thực hiện theo Quy chế học vụ theo học chế tín chỉ ban hành kèm quyết định số 561/QĐ-ĐHM ngày 08/8/2013 của Hiệu trưởng Trường Đại học Mở Tp.HCM.

STT	Điểm thành phần	Tỉ lệ %
1	Kiểm tra giữa kỳ	30%
2	Thi kiểm tra cuối kỳ	70%
	Điểm tổng kết môn học (Điểm kiểm tra giữa kỳ * 30% + Điểm thi cuối kỳ * 70%)	100%

Ghi chú:

- Điểm kiểm tra giữa kỳ: Là tổng điểm của điểm kiểm tra giữa kỳ và những điểm thành phần đánh giá khác.
- Điểm thi kiểm tra cuối kỳ: Là điểm của 01 lần thi kiểm tra tập trung do Nhà trường tổ chức.

7. Tổ chức giảng dạy và học tập

Thực hiện theo Quy chế học vụ theo học chế tín chỉ ban hành kèm quyết định số 561/QĐ-ĐHM ngày 08/8/2013 của Hiệu trưởng Trường Đại học Mở Tp.HCM.

7.1. Kế hoạch giảng dạy lớp ngày (4,5 tiết/buổi)

STT	Buổi học	Nội dung	Ghi chú
1	Buổi 1	Chương 1: Giới thiệu	
2	Buổi 2	Chương 2: Ôn tập Xác suất Thống kê	
3	Buổi 3	Chương 2 (tiếp theo)	
4	Buổi 4	Chương 3: Hàm hồi quy đơn biến	
5	Buổi 5	Chương 3 (tiếp theo)	
6	Buổi 6	Chương 4: Hàm hồi quy đa biến	
7	Buổi 7	Chương 4 (tiếp theo)	
8	Buổi 8	Chương 5: Đa cộng tuyến	
9	Buổi 9	Chương 6: Biến độc lập định tính (biến giả)	
10	Buổi 10	Chương 7: Phương sai sai số thay đổi	

7.2. Kế hoạch giảng dạy lớp tối (3,5 tiết/buổi)

STT	Buổi học	Nội dung	Ghi chú
1	Buổi 1	Chương 1: Giới thiệu	
2	Buổi 2	Chương 2: Ôn tập Xác suất Thống kê	
3	Buổi 3	Chương 2 (tiếp theo)	
4	Buổi 4	Chương 3: Hàm hồi quy đơn biến	
5	Buổi 5	Chương 3 (tiếp theo)	
6	Buổi 6	Chương 3 (tiếp theo)	
7	Buổi 7	Chương 4: Hàm hồi quy đa biến	
8	Buổi 8	Chương 4 (tiếp theo)	
9	Buổi 9	Chương 4 (tiếp theo)	
10	Buổi 10	Chương 5: Đa cộng tuyến	
11	Buổi 11	Chương 5 (tiếp theo)	

STT	Buổi học	Nội dung	Ghi chú
12	Buổi 12	Chương 6: Biến độc lập định tính (biến giả)	
13	Buổi 13	Chương 7: Phương sai sai số thay đổi	

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày tháng năm 2014

TL. HIỆU TRƯỞNG
TRƯỞNG KHOA KINH TẾ VÀ LUẬT

Đặng Văn Thanh