

Tp. Hồ Chí Minh, ngày tháng năm 2018

## ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

(Dành cho CTĐT thạc sĩ, tiến sĩ/Định hướng NC)

### 1. THÔNG TIN CHUNG VỀ HỌC PHẦN

#### 1.1. Tên học phần: Phương pháp nghiên cứu định lượng 1

Tên tiếng Anh: Quantitative Reseach Methodes 1

- Mã học phần: Số tín chỉ: 03
- Áp dụng cho ngành/chuyên ngành đào tạo: TCNH
  - + Bachelor: Thạc sĩ/ Tiến sĩ
  - + Hình thức đào tạo: Chính quy
  - + Yêu cầu của học phần: **Bắt buộc**

#### 1.2. Khoa/Bộ môn/Giảng viên phụ trách học phần: Khoa Cơ bản/Bộ môn Toán – Thống kê/ Nguyễn Huy Hoàng

#### 1.3. Mô tả học phần:

- Mô tả học phần: Học phần cung cấp kiến thức, kỹ năng căn bản mở đầu về phương pháp, các mô hình định lượng áp dụng trong phân tích kinh tế và quản trị kinh doanh nói chung và tài chính ngân hàng nói riêng.

- Phân bổ giờ tín chỉ đối với các hoạt động:
  - + Nghe giảng lý thuyết: 27
  - + Làm bài tập trên lớp: 08
  - + Thảo luận: 10
  - + Tự học: 90 tiết

#### 1.4 Các điều kiện tham gia học phần:

- Các học phần tiên quyết: *Bổ sung kiến thức về Lý thuyết xác suất và thống kê ứng dụng*

- Có máy tính

### 2. MỤC TIÊU CỦA HỌC PHẦN

#### 2.1. Mục tiêu đào tạo chung của học phần

- Kiến thức: Môn học cung cấp các phương pháp phân tích định lượng chuyên sâu, được áp dụng phổ biến trong phân tích và dự báo trong kinh tế và kinh doanh. Cụ thể bao gồm: phân tích hồi qui đa biến ứng dụng, đánh giá về mô hình, các mô hình hồi

quy với biến định tính và phân tích chính sách, phân tích nhân tố và dự báo kinh tế và kinh doanh với số liệu chuỗi thời gian. Phương pháp xây dựng mô hình định lượng trong nghiên cứu. Phần mềm EVIEWS và SPSS được sử dụng để hỗ trợ thực hiện các nội dung này. Các vấn đề được đề cập cụ thể trong môn học bao gồm: dự báo nhu cầu sản phẩm, nghiên cứu phân khúc thị trường, phân tích chính sách, xác định các nhân tố chính phản ánh nhận thức đánh giá của khách hàng về sản phẩm, dịch vụ, dự báo kinh doanh dựa trên số liệu chuỗi thời gian: giá, doanh số... xây dựng đề cương nghiên cứu các vấn đề thực tiễn của kinh tế và kinh doanh

- Kỹ năng: Kỹ năng khai thác và phân tích mô hình kinh tế lượng; Biết phân tích số liệu thống kê; Học viên phải biết phương pháp để xây dựng mô hình kinh tế lượng phù hợp với vấn đề thực tiễn trong kinh tế và quản trị kinh doanh. Kỹ năng sử dụng thành thạo phần mềm Eviews và SPSS: Nhập số liệu, xử lý số liệu, đọc và phân tích, dự báo dựa trên kết quả đạt được trên các phần mềm là một trong những kỹ năng cần thiết để học viên hoàn thành mục tiêu môn học.

- Năng lực tự chủ và trách nhiệm: yêu cầu học viên thực sự chuyên cần và có thái độ nghiêm túc trong quá trình học tập và nghiên cứu.

## **2.2. Mục tiêu đào tạo cụ thể về kiến thức của học phần**

### **Chương 1. Khai thác kết quả từ Mô hình kinh tế lượng (10)**

Giới thiệu mô hình hồi quy tuyến tính bội. Các giả thiết của phương pháp OLS. Khai thác các bài toán liên quan đến mô hình hồi quy như: phân tích các hệ số hồi quy, ước lượng khoảng cho các hệ số hồi quy, sự phù hợp hàm hồi quy, dự báo và một số dạng hàm hồi quy trong kinh tế và kinh doanh, khai thác các kết quả thống kê...

Đánh giá về mô hình: đánh giá chất lượng mô hình, hiện tượng đa cộng tuyến, phương sai của sai số thay đổi và tự tương quan của sai số ngẫu nhiên, định dạng mô hình... Phân tích bản chất, hậu quả cách phát hiện cũng như khắc phục. Hướng dẫn thực hành và ví dụ áp dụng

### **Chương 2. Phân tích hồi quy với các biến định tính (10)**

Các khái niệm về biến định tính, biến giả, kỹ thuật sử dụng biến giả. Giới thiệu một số mô hình với biến giả là biến giải thích và áp dụng phân tích chính sách; Các mô hình với biến giả là biến phụ thuộc như: mô hình xác suất tuyến tính LPM, mô hình LOGIT, mô hình PROBIT và áp dụng trong kinh tế và kinh doanh. Hướng dẫn thực hành và ví dụ áp dụng

### **Chương 3. Phân tích nhân tố (10)**

Tổng quan về phân tích nhân tố. Các bước thực hiện phân tích nhân tố; Quá trình quyết định đối với phân tích nhân tố. Hướng dẫn thực hành và ví dụ áp dụng

### **Chương 4. Dự báo với số liệu chuỗi thời gian (5)**

Tổng quan về các phương pháp dự báo; Các dạng số liệu chuỗi thời gian; Đo lường tính chính xác của dự báo; Các phương pháp làm trơn trong dự báo; Dự báo tính xu hướng; Dự báo tính xu hướng và mùa vụ; Hướng dẫn thực hành và ví dụ áp dụng.

### **Chương 5. Phương pháp xây dựng mô hình định lượng (10)**

Phân loại phương pháp nghiên cứu; Nghiên cứu thực nghiệm bằng mô hình định lượng; Các bước lập đề cương nghiên cứu; Thảo luận nhóm và xây dựng ví dụ cụ thể.

## **3. CHUẨN ĐẦU RA**

### 3.1 Chuẩn đầu ra của học phần

Mục tiêu		Chuẩn đầu ra học phần	Đáp ứng chuẩn đầu ra CTĐT
Kiến thức	<b>Ks1</b>	Khai thác kết quả từ Mô hình Kinh tế lượng	K3. Đạt được kiến thức về lý thuyết chuyên ngành chuyên sâu để có thể phát triển kiến thức mới và tiếp tục nghiên cứu ở trình độ tiến sĩ K6. Vận dụng các ppnc khoa học hiện đại để kiểm định và phát hiện các lý thuyết mới trong lĩnh vực nghiên cứu.
	<b>Ks2</b>	Phân tích hồi quy với biến định tính	
	<b>Ks3</b>	Phân tích nhân tố	
	<b>Ks4</b>	Dự báo với số liệu thời gian	
Kỹ năng	<b>Ss1</b>	Kỹ năng khai thác và phân tích mô hình kinh tế lượng, phân tích số liệu thống kê	S1 Kỹ năng phân tích, tổng hợp, đánh giá dữ liệu và thông tin về tài chính ngân hàng để đưa ra giải pháp xử lý các vấn đề thực tiễn liên quan đến lĩnh vực tài chính – ngân hàng; S2. Có kỹ năng độc lập nghiên cứu, bước đầu có thể hình thành ý tưởng khoa học phát hiện, khám phá và thử nghiệm kiến thức mới trong lĩnh vực TC-NH. S7. Có kỹ năng nghiên cứu phát triển sử dụng các công nghệ một cách sáng tạo trong lĩnh vực học thuật và nghề nghiệp liên quan trong lĩnh vực TCNH (Excel, Eviews, Spss,...)
	<b>Ss2</b>	Xây dựng mô hình kinh tế lượng	
	<b>Ss3</b>	Sử dụng các phần mềm chuyên dụng: Eviews, SPSS,...	
Năng lực tự chủ, tự chịu trách nhiệm	<b>As1</b>	Năng lực tự nghiên cứu, khám phá các vấn đề mới liên quan đến các mô hình và phương pháp định lượng	A1. Năng lực tự nghiên cứu, khám phá các vấn đề mới liên quan lĩnh vực TC-NH. A2. Năng lực đưa ra những sáng kiến quan trọng để giải quyết các vấn đề thực tiễn phát sinh trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng. A4. Năng lực dẫn dắt chuyên môn; đưa ra được những kết luận mang tính chuyên gia trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng; A6. Phẩm chất đạo đức, trách nhiệm nghề nghiệp
	<b>As2</b>	Năng lực đưa ra những sáng tạo để xây dựng mô hình kinh tế lượng giải quyết các vấn đề thực tiễn phát sinh trong thực tế	
	<b>As3</b>	Năng lực dẫn dắt chuyên môn; đưa ra được những kết luận mang tính chuyên gia trong lĩnh vực phân tích và dự báo thị trường tài chính	
	<b>As4</b>	Phẩm chất đạo đức, trách nhiệm nghề nghiệp	

	....		
--	------	--	--

### 3.2 Ma trận liên kết nội dung của học phần với chuẩn đầu ra của học phần

TT	Nội dung	Chuẩn đầu ra môn học		
		Kiến thức	Kỹ năng	Thái độ
1	Chương 1: Khai thác kết quả từ mô hình kinh tế lượng	Ks1	Ss1 Ss2 Ss3	As1, As2 As3 As4
2	Chương 2: Phân tích hồi quy với biến định tính	Ks2	Ss1 Ss2 Ss3	As1 As2, As4, As3
3	Chương 3: Phân tích nhân tố	Ks2	Ss3 Ss2	As1 As2, As4, As3
4	Chương 4: Dự báo với số liệu chuỗi thời gian	Ks3	Ss2 Ss3	As2, As4, As3
5	Chương 5: Phương pháp xây dựng mô hình định lượng trong kinh tế tài chính ngân hàng	Ks4	Ss1 Ss2 Ss3	As1 As2, As4, As3

#### 4. NỘI DUNG HỌC PHẦN VÀ KẾ HOẠCH GIẢNG DẠY

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học			Tự nghiên cứu	Phương pháp giảng dạy	Yêu cầu học viên chuẩn bị trước khi đến lớp	Ghi chú
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Bài tập	Thuyết trình				
<b>Buổi 1</b>	Chương 1	4			8	Thuyết giảng	Đọc tài liệu	
<b>Buổi 2</b>	Chương 1	2	2		8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 3</b>	Chương 1	2		2	8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 4</b>	Chương 2	2	2		8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 5</b>	Chương 2	2		2	8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 6</b>	Chương 3	2	2		8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 7</b>	Chương 3	2	2		8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 8</b>	Chương 3	2		2	8	Thuyết giảng Trình bày nhóm	Đọc tài liệu Thảo luận nhóm	
<b>Buổi 9</b>	Chương 4	2		2	8	Thuyết giảng Bài tập cá nhân	Đọc tài liệu Bài tập cá nhân	
<b>Buổi 10</b>	Chương 5	2			8	Thuyết giảng Bài tập cá nhân	Đọc tài liệu Bài tập cá nhân	

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học			Tự nghiên cứu	Phương pháp giảng dạy	Yêu cầu học viên chuẩn bị trước khi đến lớp	Ghi chú
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Bài tập	Thuyết trình				
Buổi 11	Chương 5	5		2	10	Thuyết giảng Thảo luận toàn lớp	Đọc tài liệu	
<b>Tổng</b>		<b>27</b>	<b>8</b>	<b>10</b>	<b>90</b>			

## 5. HỌC LIỆU

### 5.1. Tài liệu chính

[1]. Nguyễn Huy Hoàng, Bộ môn Toán – Thống kê, *Bài giảng Kinh tế lượng ứng dụng*, Trường Đại học Tài chính – Marketing, 2015

### 5.2. Tài liệu tham khảo và sách

[1]. Nguyễn Quang Dong, Nguyễn Thị Minh, *Giáo trình Kinh tế lượng*, NXB ĐH KTQD 2013

[2]. Nguyễn Cao Văn, Bùi Dương Hải, *Kinh tế lượng (hướng dẫn trả lời lý thuyết và giải bài tập)*, NXB Tài chính, 2009

[3]. Nguyễn Khắc Minh, *Các phương pháp phân tích và dự báo trong kinh tế*, NXB Khoa học kỹ thuật, 2002.

[4] Christiaan Heij, Paul de Boer, Philip Hans Franses, Teun Kloek, Herman K. van Dijk, *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*, Oxford University Press, 2004

[5] J.F. Hair, W.C. Black, B. J. Babin and R. E. Anderson, *Multivariate Data Analysis*, 7<sup>th</sup> ed., Pearson Prentice Hall, 2010.

[6]. D. R. Anderson, D. J. Sweeney, T. A. Williams, J. D. Camm and K. Martin, *An Introduction to Management Science - Quantitative Approaches to Decision Making*, 13<sup>th</sup> ed., South-Western, CENGAGE Learning, 2012.

## 6. PHƯƠNG PHÁP ĐÁNH GIÁ KẾT QUẢ HỌC TẬP HỌC PHẦN

Phương pháp đánh giá		Tỷ trọng, %	Đáp ứng mục tiêu, chuẩn đầu ra của học phần
Kiểm tra thường xuyên (Tỷ trọng 20%)	Đánh giá thường xuyên	20%	Ks1, Ks2, Ks3, Ks4 Ss3, Ss2
	Bài tập nhóm		

<b>Kiểm tra định kỳ</b> (Tỷ trọng 30%)	<b>Bài kiểm tra</b>	30%	Ss1, Ss2
	Bài tập cá nhân		
<b>Tiểu luận kết thúc học phần</b> (Tỷ trọng 50%)	<b>Lý thuyết</b>	30%	Ks1, Ks2, Ks3, Ks4
	<b>Thực hành</b>	20%	Ss1, Ss2, Ss3
<b>Tổng cộng</b>		100%	

**Ban Giám hiệu  
Duyệt**

**Trưởng khoa**

**Trưởng bộ môn**