

ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

1. THÔNG TIN CHUNG VỀ HỌC PHẦN

1.1 Tên học phần (tiếng Việt):	KINH TẾ LƯỢNG TRONG PHÂN TÍCH TÀI CHÍNH
1.2 Tên học phần (Tiếng Anh):	Econometrics for Coporate finance analysis
1.3 Trình độ đào tạo:	Đại học – Chương trình chuẩn
1.4 Định hướng đào tạo:	Ứng dụng
1.5 Mã học phần:	011399
1.6 Số tín chỉ:	3
1.7 Thuộc khối kiến thức:	Kiến thức chuyên ngành, thay thế tốt nghiệp
1.8 Phân bổ thời gian (số giờ):	
- Lý thuyết:	15
- Nghiên cứu tình huống và thảo luận:	0
- Thực hành: + Thực hành tích hợp: + Thực hành PM, MP, DN	60
- Tự học:	75
1.9 Bộ môn/Khoa phụ trách học phần:	Bộ môn Toán – Thống kê/Khoa Kinh tế - Luật
1.10 Điều kiện tham gia học phần:	
- Điều kiện tiên quyết:	Không
- Học phần học trước:	Kinh tế lượng
- Học phần song hành:	Không

2. MÔ TẢ TÓM TẮT NỘI DUNG CỦA HỌC PHẦN

Sử dụng các công cụ và mô hình kinh tế lượng đặc biệt các mô hình chuỗi thời gian, mô hình dữ liệu bảng vào trong phân tích dự báo các vấn đề của thị trường tài chính tiền tệ cũng như các vấn đề kinh tế vĩ mô có liên quan.

3. MỤC TIÊU CỦA HỌC PHẦN:

3.1. Mục tiêu chung:

Sau khi học xong học phần thay thế khoá luận tốt nghiệp này, sinh viên hiểu được các kiến thức cơ bản về phân tích định lượng thông qua việc phân tích các vấn đề kinh tế, tài chính; Xây dựng nên những mô hình kinh tế lượng thích hợp, kiểm chứng và khẳng định cho vấn đề kinh tế, tài chính, nhằm đạt được kết quả tối ưu trong công tác quản lý, phân tích, ước lượng và dự báo và tư vấn chính sách. và vận dụng được các công cụ chủ yếu là toán học và phương pháp luận Thống kê, được áp dụng trong kinh tế, tài chính, trong khoa học quản lý để giải quyết những bài toán do thực tiễn đặt ra; Thực hiện tìm kiếm số liệu của các biến số kinh tế, tài chính; Mô tả mối quan hệ kinh tế, tài chính, học viên phải biết cách phân tích để xây dựng mô hình kinh tế lượng phù hợp thể hiện mối quan hệ này.

3.2. Mục tiêu cụ thể:

- Về kiến thức:

Nắm vững các kiến thức cơ bản nhất về phân tích định lượng thông qua việc phân tích các vấn đề kinh tế, xây dựng nên những mô hình kinh tế lượng thích hợp giải thích cho vấn đề kinh tế đó, nhằm đạt được kết quả tối ưu trong công tác quản lý, phân tích, ước lượng và dự báo

- Về kỹ năng:

Phân tích để xây dựng nên một mô hình toán học thể hiện mối quan hệ này. Kỹ năng sử dụng thành thạo phần mềm Eviews và một số phần mềm chuyên dụng khác; Nhập số liệu, xử lý số liệu và phân tích kết quả đạt được trên phần mềm Eviews là một trong những kỹ năng cần thiết để sinh viên hoàn thành mục tiêu môn học.

- Về mức tự chủ và tự chịu trách nhiệm:

Tự trang bị phương pháp nghiên cứu định lượng để phân tích các vấn đề kinh tế và thông qua những phân tích này để đề xuất giải pháp khắc phục.

4. CHUẨN ĐẦU RA CỦA HỌC PHẦN:

4.1 Chuẩn đầu ra của học phần:

Ký hiệu	Nội dung
CLO1	Nhận diện được các khái niệm và các dạng mô hình
CLO2	Trình bày được các kết quả liên quan đến mô hình.
CLO3	Tính toán; giải quyết được các dạng bài toán vào các lĩnh vực tài chính, kinh tế.
CLO4	Phân tích được các mô hình ứng dụng.
CLO5	Đánh giá được các mô hình ứng dụng cơ bản trong các lĩnh vực tài chính, kinh tế.
CLO6	Đề xuất được các mô hình ứng dụng.

4.2 Mối quan hệ giữa chuẩn đầu ra của học phần (CLOs) với chuẩn đầu ra của chương trình đào tạo (PLOs):

Chuẩn đầu ra của học phần	PLO1	PLO2	PLO3	PLO4	PLO5	PLO6	PLO7	PLO8	PLO9	PLO10
CLO 1	M									
CLO 2		M								
CLO 3			M							
CLO 4					M					
CLO 5				M						
CLO6							M	M	M	M
Tổng hợp học phần	M	M	M	M	M		M	M	M	M

Chú thích: Mức độ đóng góp, hỗ trợ của CLOs với PLOs được xác định cụ thể như sau:

- *I (Introduced)* – Học phần có hỗ trợ đạt được PLO và ở mức giới thiệu/bắt đầu.
- *R (Reinforced)* – Học phần có hỗ trợ đạt được PLO và ở mức nâng cao hơn mức bắt đầu, có nhiều cơ hội được thực hành, thí nghiệm, thực tế,...
- *M (Mastery)* – Học phần có hỗ trợ cao đạt được PLO và ở mức thuần thục/thông hiểu
- *A (Assessed)* – Học phần quan trọng (hỗ trợ tối đa việc đạt được PLO) cần được thu thập minh chứng để đánh giá chuẩn đầu ra của chương trình đào tạo.

5. NỘI DUNG VÀ KẾ HOẠCH GIẢNG DẠY:

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
Tuần 1: Từ: Đến...	Chương 1. Tổng quan về Mô hình kinh tế lượng 1.1. Các khái niệm mở đầu về kinh tế lượng, phương pháp luận của kinh tế lượng. 1.2. Các bài toán liên quan đến mô hình hồi quy k biến	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 1. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 2: Từ: Đến...	1.3. Một số khuyết tật trong mô hình hồi quy 1.4. Phân tích đặc trưng mô hình, các thuộc tính của một mô hình tốt. Các loại sai lầm chỉ định, cách tiếp cận để lựa chọn mô hình.	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 1. *) Chuẩn bị các câu hỏi

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
Tuần 3: Từ: Đến...	1.5. Các khái niệm về biến giả, kỹ thuật sử dụng biến giả. 1.6.Giới thiệu một số mô hình với biến giả là biến giải thích, so sánh cấu trúc của mô hình hồi quy, hồi quy tuyến tính từng khúc, phân tích mùa vụ. 1.7. Tham khảo các mô hình với biến giả là biến phụ thuộc như: LPM, LOGIT, PROBIT	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 1. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 4: Từ: Đến...	Chương 2. Phân tích chuỗi thời gian 2.1.Khái niệm chuỗi thời gian, các thành phần của chuỗi thời gian. 2.2.Chuyển đổi số liệu chuỗi thời gian	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 2. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 5:	2.3. Phân rã chuỗi thời gian,	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng	*) Đọc tài liệu [1], Chương 2.

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
Từ: Đến...	2.4. Hồi quy chuỗi thời gian, tính dừng và nhiễu trắng.						+ Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 6: Từ: Đến...	Chương 3. Hồi quy đơn chuỗi: các mô hình AR, MA và ARMA 3.1.Mô hình tự hồi quy AR; 3.2. Mô hình trung bình động MA;	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 3. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 7: Từ: Đến...	3.3. Mô hình ARMA(p,q);	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt	*) Đọc tài liệu [1], Chương 3. *) Chuẩn bị các câu hỏi

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
							câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	
Tuần 8: Từ: Đến...	Chương 4. Chuỗi không dừng, kiểm định nghiệm đơn vị, phương pháp BOX – JENKINS (5) 4.1.Khái niệm chuỗi thời gian không dừng 4.2.Kiểm định nghiệm đơn vị(kiểm định Dickey – Fuller, kiểm định Phillips – Perron);	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 4. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 9: Từ: Đến...	4.3.Phương pháp BOX – JENKINS và kiểm định sự vi phạm các giả định.	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 4. *) Chuẩn bị các câu hỏi

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
Tuần 10: Từ: Đến...	4.4. Mô hình VAR và áp dụng trong kinh tế tài chính.	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 4. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 11: Từ: Đến...	4.5. Kiểm định đồng liên kết và mô hình hiệu chỉnh sai số VECM. Ví dụ áp dụng	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 4. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 12: Từ: Đến...	Chương 5. Mô hình hóa phương sai: các mô hình ARCH và GARCH 5.1. Mô hình ARCH	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi	*) Đọc tài liệu [1], Chương 5.

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
							- Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 13: Từ: Đến...	5.2. Mô hình GARCH	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Đọc tài liệu [1], Chương 5. *) Chuẩn bị các câu hỏi
Tuần 14: Từ: Đến...	5.3. Một số dạng mô hình GARCH khác	1	0	0	4	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu	*) Đọc tài liệu [1], Chương 5. *) Chuẩn bị các câu hỏi

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học					Phương pháp giảng dạy – học tập	Yêu cầu sinh viên chuẩn bị trước khi đến lớp
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Thực hành tích hợp	Nghiên cứu tình huống và thảo luận	Thực hành tại PM, PMP, DN	Tự học		
							có), trả lời câu hỏi.	
Tuần 15: Từ: Đến...	Ôn tập, giải đáp các thắc mắc và công bố kết quả đánh giá quá trình	1	0	0	4	5	- Giảng viên: Tóm tắt nội dung học tập + Hướng dẫn SV ôn tập - Sinh viên: + Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi ôn tập.	Chuẩn bị trước các câu hỏi ôn tập
Tổng		15	0	0	60	90		

6. HỌC LIỆU:

6.1 Tài liệu chính: (tối đa 3 quyển)

[1] Giáo trình bài giảng Kinh tế lượng ứng dụng trong tài chính, Trường Đại học Tài chính Marketing, 2015.

6.2 Tài liệu tham khảo: (tối đa 5 quyển)

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

[3]. Phạm Thế Anh, Kinh tế lượng ứng dụng phân tích chuỗi thời gian, NXB Lao động, 2013.

[4] Tsay, R.S, Analysis of Financial Time Series. John-Wiley & Sons, Inc., New York, 2002

[5] Chris Brooks, Introductory econometrics for Finance, Cambridge, University press, 2002

7. PHƯƠNG PHÁP ĐÁNH GIÁ KẾT QUẢ HỌC TẬP HỌC PHẦN

7.1 Đánh giá quá trình: trọng số 40% trong điểm học phần

TT	PHƯƠNG PHÁP ĐÁNH GIÁ	MÔ TẢ	CÁC CDR ĐƯỢC ĐÁNH GIÁ	CẤU TRÚC ĐIỂM THÀNH PHẦN
1	Điểm chuyên cần và thái độ học tập: Mức độ tham gia lớp học và các hoạt động đóng góp ý kiến, trả lời các câu hỏi.	- Đánh giá tham gia các buổi học đầy đủ. - Đánh giá mức độ tích cực chủ động trong đóng góp xây dựng bài, tham gia thảo luận, đặt câu hỏi tích cực. Đóng góp ý kiến cá nhân	CLO1 CLO2	20%
2	Kiểm tra giữa kỳ: Tự luận 100%, từ 5 câu bài tập, nội dung từ chương 1 đến chương 3. Thời gian làm bài 60 – 75 phút.	- Đánh giá được mức độ tiếp thu và vận dụng kiến thức của từng sinh viên	CLO1 CLO2 CLO3 CLO4 CLO5 CLO6	80%
TỔNG				100%

7.2 Đánh giá kết thúc học phần: trọng số 60% trong điểm học phần

PHƯƠNG PHÁP ĐÁNH GIÁ	MÔ TẢ	CÁC CDR ĐƯỢC ĐÁNH GIÁ	CẤU TRÚC ĐIỂM THÀNH PHẦN
TIỂU LUẬN Viết tiểu luận về áp dụng môn học cho một vấn đề cụ thể	Đánh giá về kiến thức: Đánh giá khả năng hiểu biết về nội dung môn học	CLO1 CLO2	30%
	Đánh giá về kỹ năng: Đánh giá khả năng vận dụng các phương pháp, áp dụng giải các bài toán thực tế	CLO3 CLO4 CLO5 CLO6	70%
Tổng			100%

8. QUY ĐỊNH CỦA HỌC PHẦN

8.1 Quy định về tham dự lớp học

- Tham gia lớp học nghiêm túc, tuân thủ các quy định chung của nhà trường.

8.2 Quy định về hành vi lớp học

- Sinh viên tham gia lớp học với tinh thần nghiêm túc, cầu thị.
- Sinh viên không làm việc riêng trong thời gian lên lớp, chỉ sử dụng các thiết bị phục vụ cho nội dung học và hoạt động tương ứng trong từng buổi học.

8.3 Quy định về học vụ

- Sinh viên vắng quá số buổi quy định sẽ bị trừ điểm theo đúng quy định về nội quy tham gia lớp học
- Kết quả học tập sẽ được công bố trên các nền tảng trực tuyến của Trường theo đúng quy định

9. HOLISTIC RUBRIC:

9.1. Rubric đánh giá điểm quá trình :

- Rubric đánh giá chuyên cần và thái độ học tập (chiếm 20%/ điểm quá trình)

Tiêu chí	CĐR	Tỷ lệ	Mức chất lượng			
			Không đạt	Đạt	Tốt	Rất tốt
			0 – 4,9	5,0 – 6,9	7,0 – 8,4	8,5 – 10
Số buổi dự học (đủ tiết/buổi) theo thời khóa biểu	CLO1 CLO2	80%	Tham dự < 70% số buổi học	Tham dự từ 70% đến < 80% số buổi học	Tham dự từ 80% đến < 90% số buổi học	Tham dự từ 90% số buổi học trở lên.
Sự chủ động, tích cực tham gia thảo luận/trả lời câu hỏi	CLO1 CLO2	20%	Không tham gia thảo luận/trả lời đúng dưới 50% các câu hỏi về nội dung bài học.	Có tham gia thảo luận và trả lời đúng từ 50% đến dưới 70% các câu hỏi về nội dung bài học.	Có tham gia thảo luận và trả lời đúng từ 70% đến dưới 85% các câu hỏi về nội dung bài học.	Nhiệt tình tham gia thảo luận và trả lời đúng từ 85% đến 100% các câu hỏi về nội dung bài học.

- Rubric đánh giá bài kiểm tra giữa kỳ (chiếm 80% điểm quá trình)

Tiêu chí	CĐR	Tỷ lệ	Mức chất lượng			
			Không đạt	Đạt	Tốt	Rất tốt
			0 – 4.5	5.0 – 6.5	7.0 – 8.5	8.5 – 10
Các câu hỏi ở mức độ cơ bản	CLO1 CLO2 CLO3	70%	Không làm đúng/Trình bày các bước rõ ràng	Làm đúng từ 2 – 3 câu	Làm đúng từ 3 – 4 câu	Làm đúng trên 4 câu
Các câu hỏi ở mức độ nâng cao	CLO4 CLO5 CLO6	30%	Không làm đúng/Trình bày các bước rõ ràng	Làm đúng từ 2 – 3 câu	Làm đúng từ 3 – 4 câu	Làm đúng trên 4 câu

- Rubric đánh giá kết thúc học phần)

Tiêu chí	CĐR	Tỷ lệ	Mức chất lượng			
			Không đạt	Đạt	Tốt	Rất tốt
			0 – 4.5	5.0 – 6.5	7.0 – 8.5	8.5 – 10
Vận dụng kiến thức môn học	CLO1 CLO2 CLO3 CLO4 CLO5 CLO6	100%	Không làm đúng theo yêu cầu tiểu luận/ Làm sai chủ đề	Hoàn thiện các yêu cầu ở mức thấp/ Trình bày sơ sài	Hoàn thiện tiểu luận, Vận dụng đúng mô hình, Có áp dụng thực tế.	Hoàn thiện tiểu luận, Vận dụng đúng mô hình, Có áp dụng thực tế. Có tính mới trong kết quả

Bảng Rubric đánh giá kết quả chuẩn đầu ra học phần

Chuẩn đầu ra môn học	Tỷ lệ	Mới bắt đầu	Biết sơ sài	Hiểu sơ bộ	Hiểu căn kẽ	Hiểu sâu
		0 - 3.4	3.5 - 4.9	5.0 - 6.9	7.0-8.4	8.5-10
CLO1	10%	Mới thu nhận được một số ít thông tin mang tính rời rạc	Mới thiết lập được sự liên hệ giữa một số ít thông tin được thu nhận	Hiểu được các thông tin cơ bản và thiết lập được mối liên hệ sơ lược giữa chúng	Hiểu khá đầy đủ các thông tin cần thiết và thiết lập được mối liên hệ giữa chúng	Hiểu đầy đủ các thông tin cần thiết. Có thể khái quát hóa các thông tin thu nhận, đánh giá và vận dụng chúng vào các tình huống khác nhau, hoặc sáng tạo ra cái mới
CLO2	20%					
CLO3	20%					
CLO4	20%					
CLO5	20%					
CLO6	10%					
Tổng điểm	100%					

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 8 tháng 7 năm 2022

P. Hiệu trưởng ✓

KT. Trưởng khoa

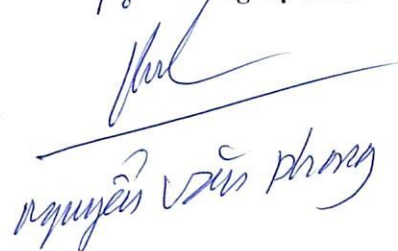
P. Trưởng bộ môn



TS. Nguyễn Văn Diện



Trần Văn Bình



Nguyễn Văn Phong