

ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

1. THÔNG TIN CHUNG VỀ HỌC PHẦN

1.1 Tên học phần (tiếng Việt):	PHÂN TÍCH CHUỖI THỜI GIAN
1.2 Tên học phần (Tiếng Anh):	Time series 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:	011392
1.6 Số tín chỉ:	3
1.7 Thuộc khối kiến thức:	Kiến thức ngành
1.8 Phân bổ thời gian (số giờ):	
- Lý thuyết:	30
- Nghiên cứu tình huống và thảo luận:	30
- Thực hành: + Thực hành tích hợp: + Thực hành PM, MP, DN	
- Tự học:	90
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:	Lý thuyết xác suất và thống kê ứng dụng; Kinh tế lượng
- Học phần song hành:	Không

2. MÔ TẢ TÓM TẮT NỘI DUNG CỦA HỌC PHẦN

Học phần cung cấp cho sinh viên những kiến thức cơ bản về phương pháp phân tích định lượng một vấn đề kinh tế thông qua chuỗi thời gian tương ứng. Các mô hình hồi quy thời gian đơn chuỗi như $AR(p)$, $MA(q)$, $ARMA(p,q)$, và đa chuỗi như $VAR(p)$, $VECM$, $ARCH$, $GARCH$. Giới thiệu một số phương pháp khác trong dự báo và phân tích kinh tế và tài chính. Những kỹ thuật này sẽ được minh họa cụ thể nhờ phần mềm Eviews và R. Kết thúc học phần sinh viên phải biết cách lựa chọn, kiểm định cho các mô hình dự báo được sử dụng.

MỤC TIÊU CỦA HỌC PHẦN:

3.1. Mục tiêu chung:

Sau khi học xong học phần này, sinh viên hiểu được các kiến thức về phân tích chuỗi thời gian và các mô hình phân tích và dự báo ARMA, VAR, VECM; Nhận dạng quá trình và dùng các phần mềm Eviews, R để phân tích chuỗi thời gian; Thực hiện được các kỹ thuật phân tích thống kê mô tả với các loại dữ liệu khác nhau; nhận biết được chuỗi dừng và không dừng thông qua phương pháp giản đồ tự tương quan cũng như phương pháp kiểm định nghiệm đơn vị; nhận diện, đánh giá và lựa chọn mô hình dự báo tốt cho một chuỗi dữ liệu sẵn có; thực hiện được các mô hình dự báo đơn biến, đa biến; Áp dụng mô hình tương ứng và thực hiện dự báo trên chuỗi thời gian.

3.2. Mục tiêu cụ thể:

- *Về kiến thức:* Vận dụng các kỹ thuật phân tích thống kê mô tả với các loại dữ liệu khác nhau; nhận biết được chuỗi dừng và không dừng thông qua phương pháp giản đồ tự tương quan cũng như phương pháp kiểm định nghiệm đơn vị; nhận diện, đánh giá và lựa chọn mô hình dự báo tốt cho một chuỗi dữ liệu sẵn có; thực hiện được các mô hình dự báo đơn biến, đa biến.

- *Về kỹ năng:*

Trước một bộ số liệu mô tả mối quan hệ kinh tế, sinh viên phải biết cách phân tích, nhận dạng, từ đó áp dụng mô hình tương ứng và thực hiện dự báo trên chuỗi thời gian. Kỹ năng sử dụng thành thạo phần mềm Eviews, R: Nhập số liệu, xử lý số liệu và phân tích kết quả đạt được trên phần mềm Eviews và R 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 trau dồi kỹ năng tự nghiên cứu và kỹ năng làm việc theo nhóm. Nắm và tuân thủ các nguyên lý của các mô hình và vận dụng các mô hình trong phân tích kinh tế và kinh doanh.

4. CHUẨN ĐẦU RA CỦA HỌC PHẦN:

4.1 Chuẩn đầu ra của học phần:

Ký hiệu	Nội dung
CLO1	Phân loại được các khái niệm và các dạng bài toán
CLO2	Trình bày được các định nghĩa và các kết quả liên quan.
CLO3	Giải quyết được các dạng bài toán; Áp dụng vào các bài toán trong các lĩnh vực tài chính, kinh tế.
CLO4	Phân tích được các mô hình ứng dụng.
CLO5	Xây dựng được các mô hình ứng dụng cơ bản trong các lĩnh vực tài chính, kinh tế
CLO6	Đánh giá được các kết quả trong 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	R			R						
CLO 2	R	R			R					
CLO 3		R		R	R					
CLO 4					R					
CLO 5				R	R		R	R		
CLO6					R	I	R	R	M	M
Tổng hợp học phần	R	R		R	R	I	R	R	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: Đại cương về chuỗi thời gian 1. Khái niệm về chuỗi thời gian 2. Các thành phần của chuỗi thời gian. Tách thành phần xu hướng và thành phần mùa 3. Mô hình dự báo đại lượng ngẫu nhiên 4. Nhiễu trắng, quá trình dừng, toán tử lùi, bước nhảy ngẫu nhiên 5. Các phương pháp làm tron	3	0	2	0	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...	4. Nhiễu trắng, quá trình dừng, toán tử lùi, bước nhảy ngẫu nhiên 5. Các phương pháp làm tron	1	0	4	0	10	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu	*) 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		
							có), trả lời câu hỏi.	
Tuần 3: Từ: Đến...	Chương 2. Quá trình ARMA 1. Quá trình tự hồi qui AR 2. Quá trình trung bình trượt MA 3. Quá trình tự hồi qui trung bình trượt ARMA	3	0	2		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 4: Từ: Đến...	4. Quá trình hợp nhất tự hồi qui trung bình trượt ARIMA	1	0	4		10	- 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

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 5: Từ: Đến...	Chương 3. Nhận dạng quá trình ARMA 1. Các giả thiết và công cụ tính toán 2. Kiểm tra tính dừng 3. Nhận dạng quá trình AR	3	0	2	0	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 6: Từ: Đến...	3. Nhận dạng quá trình AR	3	0	2	0	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...	4. Ước lượng các tham số của quá trình ARMA 5. Xử lý mùa trong mô hình ARMA	1	0	4	0	5	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi	*) Đọc tài liệu [1], Chương 3.

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 8: Từ: Đến...	6. Dự báo trên mô hình ARIMA	3	0	2	0	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 9: Từ: Đến...	Chương 4. Mô hình hồi quy đa chuỗi 4.1.Khái niệm chuỗi thời gian dừng 4.2.Kiểm định nghiệm đơn vị	3	0	2	0	10	- Giảng viên: + Thuyết giảng + Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu	*) 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		
							có), trả lời câu hỏi.	
Tuần 10: Từ: Đến...	4.1. Mô hình VAR và áp dụng. 4.2. Kiểm định đồng liên kết và mô hình hiệu chỉnh sai số VECM.	3	0	2	0	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...	4.2. Kiểm định đồng liên kết và mô hình hiệu chỉnh sai số VECM.	3	0	2	0	10	- 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:	Ôn tập, giải đáp các thắc mắc và	3	0	2	0	15	- Giảng viên: + Tóm tắt nội dung mô học	*) Đọc tài liệu [1]

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...	công bố kết quả đánh giá quá trình						+ Đặt câu hỏi - Sinh viên: Nghe giảng, ghi chép, đặt câu hỏi (nếu có), trả lời câu hỏi.	*) Chuẩn bị các câu hỏi
Tổng		30		30		90		

6. HỌC LIỆU:

6.1 Tài liệu chính: (tối đa 3 quyển)

[1] Giáo trình bài giảng Phân tích chuỗi thời gian, Đại học Tài chính – Marketing, 2014

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

[2] Nguyễn Hồ Quỳnh, Chuỗi thời gian. Phân tích và nhận dạng, NXB Khoa học Kỹ thuật, 2004.

[3] Hoài, N.T., Bình, P.T & Duy, N.K. (2009), Dự Báo và Phân Tích Dữ Liệu trong Kinh Tế và Tài Chính, NXB Thống Kê. (Giáo trình)

[4] Hill, R.C., Griffiths, W.E. & Lim, G.C. (2008), Using Eviews for Principles of Econometrics, 3rd Edition, John Wiley & Sons.

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 bài toán 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%					

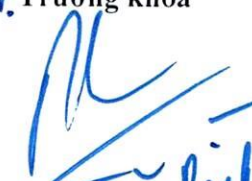
Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 8 tháng 7 năm 2022

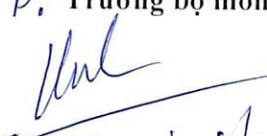
P. Hiệu trưởng

KT. Trưởng khoa

P. Trưởng bộ môn


TS. Nguyễn Văn Tuấn


Trần Văn Bình


Nguyễn Văn Phong