

KINH TẾ LƯỢNG

Tài liệu môn học:

- **Nguyễn Quang Dong, Nguyễn Thị Minh**, Giáo trình Kinh tế lượng, Nhà xuất bản Đại học Kinh tế Quốc dân, năm 2012.
- **Hoàng Ngọc Nhậm** (chủ biên), Giáo trình Kinh tế lượng, Nhà xuất bản Lao động- Xã hội, năm 2008.
- Máy tính cá nhân, phần mềm Eviews

NỘI DUNG MÔN HỌC

Chương 1: MÔ HÌNH HỒI QUY 2 BIẾN

Chương 2: MÔ HÌNH HỒI QUY BỘI

Chương 3: SUY DIỄN THỐNG KÊ VÀ DỰ BÁO

Chương 4: PHÂN TÍCH HỒI QUY VỚI BIẾN ĐỊNH TÍNH

Chương 5: TỰ TƯƠNG QUAN

Chương 6: KIỂM ĐỊNH VÀ LỰA CHỌN MÔ HÌNH

Chương mở đầu: NHẬP MÔN KINH TẾ LƯỢNG

1. KINH TẾ LƯỢNG LÀ GÌ?
2. PHƯƠNG PHÁP LUẬN CỦA KINH TẾ LƯỢNG
3. SỐ LIỆU CHO PHÂN TÍCH KINH TẾ LƯỢNG

1. KINH TẾ LƯỢNG LÀ GÌ?



Năm 1926, Ragnar Frisch (Na Uy, Nobel 1969) công bố bài báo đầu tiên về KTL “Sur unprobleme d’ économie pure”: “Chúng tôi tìm ra một nguyên tắc mới, trung gian giữa toán học, thống kê và kinh tế, vì chưa tìm ra các tên nào tốt hơn, tạm gọi là *econometrics*”.

Năm 1939, J. Tinbergen (Anh) công bố tác phẩm trước hội đồng kinh tế Hà Lan “Statistical Testing of Business - Cycle Theory”; sau đó là quyển “Business Cycle in The United State of America, 1919 - 1932”.

1. KINH TẾ LƯỢNG LÀ GÌ?

Kinh

tế

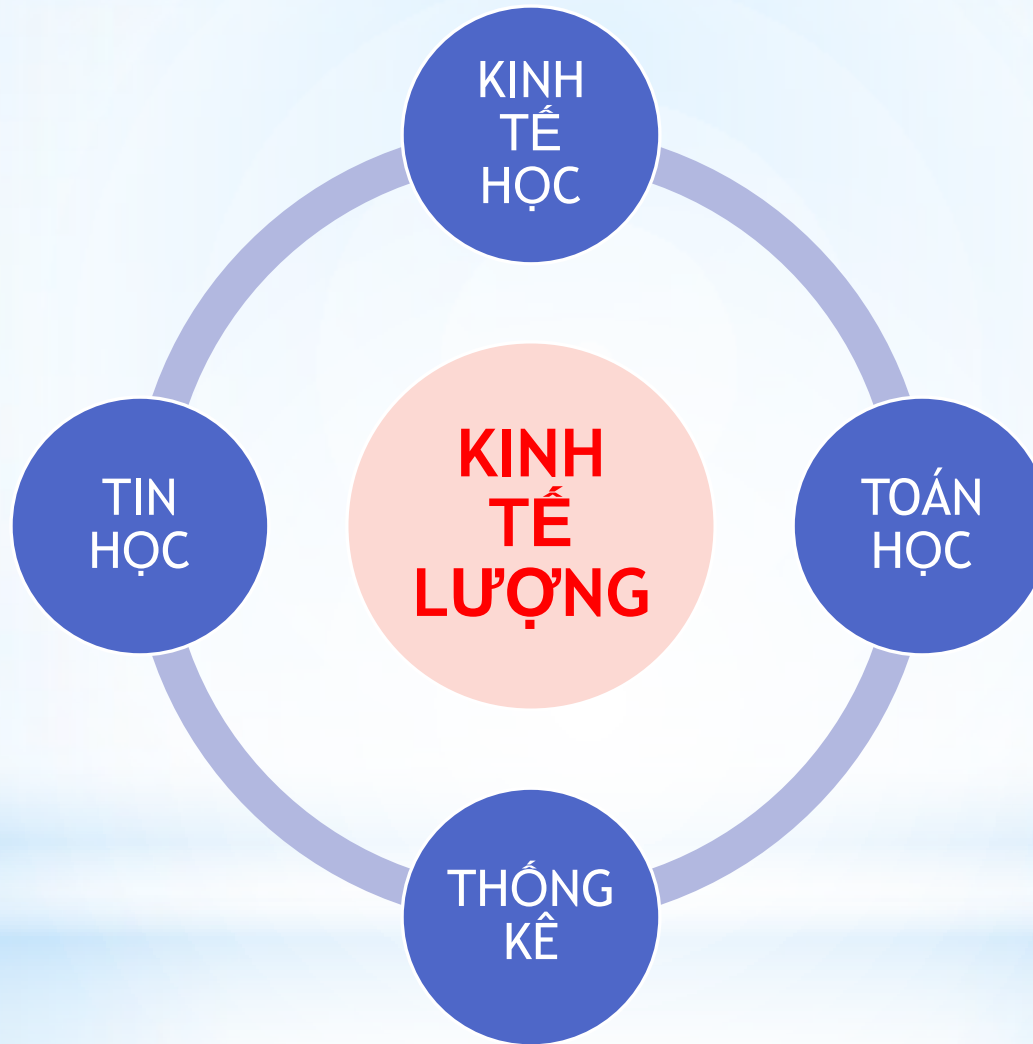
lượng

- Áp dụng thống kê toán cho các số liệu kinh tế để củng cố về mặt thực nghiệm cho các mô hình do các nhà kinh tế đề xuất và tìm ra lời giải bằng số (Tintner, 1968)

- Sự phân tích về lượng các vấn đề kinh tế hiện thời dựa trên việc vận dụng đồng thời lý thuyết và thực tế được thực hiện bằng các phương pháp suy đoán thích hợp (Sammuelson, Koopmans và Stone, 1954)

- Kiểm định thực nghiệm các quy luật kinh tế (Theil, 1971)

1. KINH TẾ LƯỢNG LÀ GÌ?



1. KINH TẾ LƯỢNG LÀ GÌ?

Mục

- Thiết lập các mô hình toán học để mô tả các mối quan hệ kinh tế.

đích

của

Kinh tế

- Kiểm định tính vững chắc của các giả thuyết.

lượng

- Sử dụng các mô hình đã được kiểm định để dự báo và mô phỏng các hiện tượng kinh tế.

- Đề xuất chính sách dựa trên các phân tích và dự báo.

2. PHƯƠNG PHÁP LUẬN CỦA KINH TẾ LƯỢNG

Nêu các giả thuyết

Thiết lập mô hình

Thu thập số liệu

Ước lượng tham số

Phân tích kết quả

Dự báo

Ra quyết định

1. H1: Vốn tác động cùng chiều đến sản lượng.

H2: Lao động tác động cùng chiều đến sản lượng.

2. Mô hình $Q = \alpha \cdot K^\beta \cdot L^\gamma$.

hay $\ln(Q) = \alpha' + \beta \ln(K) + \gamma \ln(L) + u$

3. Thu thập dữ liệu.

4. Thực hiện ước lượng các hệ số bằng các phương pháp phù hợp.

$$Q = 75114 \cdot K^{0,175} \cdot L^{0,904} \cdot e^u$$

5. Phân tích yếu tố kinh tế và yếu tố kỹ thuật kết quả nhận được.

6. Dự báo.

7. Đề ra chính sách

3. SỐ LIỆU CHO PHÂN TÍCH KINH TẾ LƯỢNG

* Phân loại dữ liệu:

- **Dữ liệu chéo (Cross Data):**

Dữ liệu của nhiều đối tượng tại cùng thời điểm.

- **Dữ liệu chuỗi thời gian (Time Series Data):**

Dữ liệu của một đối tượng trong một khoảng thời gian, khoảng cách giữa các thời điểm lấy dữ liệu là bằng nhau.

- **Dữ liệu bảng (Panel Data):**

Dữ liệu của nhiều đối tượng trong một khoảng thời gian.

* Nguồn gốc dữ liệu

- Dữ liệu thực nghiệm
- Dữ liệu phi thực nghiệm