**TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG**

**Khoa/Viện: Khoa Kế toán - Tài chính**

**Bộ môn: Bộ môn Tài chính - Ngân hàng**

**ĐỀ CƯƠNG HỌC PHẦN**

**1. Thông tin về học phần:**

Tên học phần:

* Tiếng Việt: **Kinh tế lượng trong tài chính**
* Tiếng Anh: **Econometrics in Finance**

Mã học phần: Số tín chỉ: 2 (30LT)

Đào tạo trình độ: Đại học

Chương trình đào tạo: Công nghệ tài chính

Học phần tiên quyết:

**2. Mô tả tóm tắt học phần:**

Học phần cung cấp cho sinh viên những kiến thức cơ bản và chuyên sâu về kinh tế lượng, ứng dụng các phương pháp và mô hình kinh tế lượng trong việc phân tích và dự báo tài chính. Sinh viên sẽ được học cách sử dụng các phần mềm phân tích dữ liệu và áp dụng các kỹ thuật kinh tế lượng vào các tình huống thực tế trong tài chính.

**3. Mục tiêu:**

Môn học trang bị cho sinh viên kiến thức nền tảng và nâng cao về kinh tế lượng trong tài chính. Giúp người học phát triển kỹ năng sử dụng các công cụ và phương pháp kinh tế lượng để phân tích dữ liệu tài chính. Khuyến khích tinh thần học hỏi, sáng tạo và trách nhiệm trong việc áp dụng kinh tế lượng vào phân tích tài chính.

**4. Chuẩn đầu ra học phần (CLOs):** Sau khi học xong học phần, sinh viên có thể:

a. Mô tả và giải thích các khái niệm cơ bản và nâng cao về kinh tế lượng.

b. Áp dụng các mô hình kinh tế lượng để phân tích dữ liệu tài chính.

c. Sử dụng thành thạo các phần mềm phân tích dữ liệu kinh tế lượng.

d. Đánh giá và đưa ra quyết định tài chính dựa trên kết quả phân tích kinh tế lượng.

**5. Ma trận tương thích giữa Chuẩn đầu ra HP với Chuẩn đầu ra CTĐT:**

|  |  |
| --- | --- |
| **Chuẩn đầu ra học phần** | **Chuẩn đầu ra chương trình (PLOs)** |
| **1** | **2** | **3** | **4** | **5** | **6** | **7** | **8** |
| a | X | X | X |  |  |  |  |  |
| b |  |  | X | X | X |  |  |  |
| c |  |  | X | X | X | X |  |  |
| d |  |  |  | X |  | X |  |  |

**6. Nội dung:**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Chương/Chủ đề** | **Nhằm đạt CLOs** | **Số tiết** |
| **LT** | **TH** |
| 11.11.21.31.4 | Giới thiệu về kinh tế lượng trong tài chính Định nghĩa và vai trò của kinh tế lượng trong tài chínhỨng dụng của kinh tế lượng trong phân tích tài chínhCác phương pháp cơ bản trong kinh tế lượngGiới thiệu về phần mềm phân tích kinh tế lượng | a | 4 |  |
| 22.12.22.32.4 | Các mô hình hồi quy tuyến tínhKhái niệm và cấu trúc của mô hình hồi quy tuyến tínhƯớc lượng các tham số của mô hình hồi quyKiểm định giả thiết trong mô hình hồi quy tuyến tínhỨng dụng mô hình hồi quy đơn giản trong tài chính | b | 6 |  |
| 33.13.23.33.4 | Hồi quy bội và phân tích đa biếnKhái niệm và cấu trúc của mô hình hồi quy bội Ước lượng các tham số của mô hình hồi quy bội Kiểm định và xử lý vấn đề đa cộng tuyếnỨng dụng mô hình hồi quy bội trong phân tích tài chính | b, c | 6 |  |
| 44.14.24.34.4 | Các vấn đề trong mô hình hồi quy Vấn đề tự tương quan và cách xử lý Vấn đề phương sai sai số thay đổi và cách xử lý Vấn đề thiếu sót biến trong mô hình hồi quy Các biện pháp khắc phục các vấn đề trong mô hình hồi quy | b, c | 6 |  |
| 55.15.25.35.4 | Mô hình dự báo tài chính Các phương pháp dự báo tài chính Ước lượng mô hình dự báo Kiểm định và đánh giá mô hình dự báo Ứng dụng mô hình dự báo trong thực tiễn tài chính | b, c, d | 4 |  |
| 66.16.26.36.4 | Ứng dụng kinh tế lượng trong thực tiễn tài chínhCác trường hợp thực tiễn sử dụng kinh tế lượng trong TCPhân tích dữ liệu tài chính thực tếSử dụng phần mềm phân tích kinh tế lượngBáo cáo và trình bày kết quả phân tích kinh tế lượng | d | 4 |  |

**7. Phương pháp dạy học và kiểm tra, đánh giá để đạt Chuẩn đầu ra HP**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Phương pháp dạy học** | **Áp dụng cho chủ đề** | **Nhằm đạt CLOs** |
| 1 | Thuyết giảng, thảo luận | 1, 2, 3 | a, b, c  |
| 2 | Thuyết giảng/Bài tập/Thảo luận | 3, 4, 5 | b, d  |
| 3 | Thực hành phân tích tài chính | 3, 4 | b, c  |

**8. Đánh giá kết quả học tập:**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Hình thức đánh giá** | **Nhằm đạt CLOs** | **Trọng số (%)** |
| 1 | Đánh giá quá trình | a, b, c, d | 50 |
| 2 | Thi cuối kỳ | a, b, c, d | 50 |

**9. Tài liệu dạy và học:**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **STT** | **Tên tác giả** | **Tên tài liệu** | **Năm xuất bản** | **Nhà xuất bản** | **Địa chỉ khai thác tài liệu** | **Mục đích sử dụng** |
| **Tài liệu chính** | **Tham khảo** |
| 1 | Nguyễn Hữu Mạnh và cộng sự | Bài giảng kinh tế lượng trong tài chính | 0 |  | NTU-Elearning | X |  |
| 2 | Nguyễn Quang Dong, & Nguyễn Thị Minh. | Giáo trình Kinh tế lượng. | 2013 | NXB Đại họcKinh tế quốc dân. |  |  | X |
| 3 | Gujarati, D.N. | Basic Econometrics | 2016 | McGraw-Hill | Thư viện ĐHNT |  | X |
| 4 | Brooks, C. | Introductory Econometrics for Finance | 2019 | Cambridge University Press | Thư viện ĐHNT |  | X |
| 5 | Campbell, J.Y., Lo, A.W., MacKinlay, A.C. | The Econometrics of Financial Markets | 2019 | Princeton University Press | Thư viện ĐHNT |  | X |
| 6 | Brealey, Myers, và Allen | Principles of Corporate finance | 2011 | McGraw Hill Irwin | Thư viện ĐHNT |  | X |

*Ngày cập nhật*: *18/08/2024*

 **NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN**

 **Nguyễn Hữu Mạnh**

 **TRƯỞNG KHOA/VIỆN TRƯỞNG BỘ MÔN**