

Sử dụng thống kê Bayes mờ trong dự báo tỷ giá và một số chỉ số kinh tế

Lê Thanh Hoa⁽¹⁾ • Phạm Hoàng Uyên⁽²⁾ • Nguyễn Phúc Sơn⁽³⁾

Ngày nhận bài: 24/5/2017 | Biên tập xong: 02/11/2017 | Duyệt đăng: 10/11/2017

TÓM TẮT: Xu thế chung của thế giới là tăng cường hợp tác quốc tế, đa phương hóa và đa dạng hóa các mối quan hệ. Việc này đem đến những cơ hội rất lớn cho nền kinh tế quốc gia nhưng cũng đặt ra nhiều thách thức. Trong điều kiện cạnh tranh toàn cầu, việc áp dụng các tri thức mới vào tình huống thực tế trong quá trình phát triển kinh tế trở nên cần thiết và cấp bách. Một trong những xu hướng nền tảng cho cuộc cách mạng công nghiệp lần thứ tư là khoa học dữ liệu; cụ thể hơn, nhóm tác giả nghiên cứu ứng dụng của nó vào kinh tế học tài chính. Trong bài viết này, nhóm tác giả sử dụng công cụ thống kê mới là Bayes mờ áp dụng trong dự báo các chỉ số kinh tế. Việc dự báo đúng trên 80% và thậm chí trên 90% tùy vào từng trường hợp và hứa hẹn rằng đây là một phương pháp triển vọng.

TỪ KHÓA: thống kê Bayes mờ, khoa học dữ liệu, dữ liệu mờ, dự báo, dữ liệu tài chính, thuật toán.

1. Giới thiệu

Các hiệp định song phương và đa phương mà Việt Nam đã ký kết kỳ vọng mang lại những cơ hội nhưng cũng nhiều thách thức cho các ngành kinh tế trong nước. Việc xuất khẩu một số mặt hàng nông sản bên cạnh thách thức của các rào cản kỹ thuật như TBT (hàng rào kỹ thuật thương mại) hay SPS (biện pháp vệ sinh dịch tễ) thì giá cả cũng là một vấn đề đáng được quan tâm. Giá cả phải đảm bảo cân bằng giữa tiền công lao động, lợi nhuận và uy tín. Đây là vấn đề quan trọng khi chúng ta tham gia AEC (Cộng đồng Kinh tế ASEAN) với mục tiêu thúc đẩy tự do hóa thương mại nội khối và đẩy nhanh quá trình gắn kết các thành viên trong một sân chơi chung, thúc đẩy sự thịnh vượng của từng thành viên. Giá trị của đồng

tiền không xuất phát từ bản thân tiền tệ mà được hình thành từ sự vững mạnh của quốc gia. Tuy nhiên, nền kinh tế phát triển ổn định là điều kiện đảm bảo vững chắc cho nền tiền

(1) **Lê Thanh Hoa - Email:** hoalt@uel.edu.vn.

(2) **Phạm Hoàng Uyên - Email:** uyenph@uel.edu.vn.

(3) **Nguyễn Phúc Sơn - Email:** sonnp@uel.edu.vn.

(1) Trường Đại học Khoa học Tự nhiên, Đại học Quốc gia TP.HCM; 227 Nguyễn Văn Cừ, Phường 4, Quận 5, TP. Hồ Chí Minh.

(2), (3) Trường Đại học Kinh tế - Luật, Đại học Quốc gia TP.HCM; Khu phố 3, Phường Linh Xuân, Quận Thủ Đức, TP. Hồ Chí Minh.