

ỨNG DỤNG MÔ HÌNH ARIMA TRONG DỰ BÁO CHỈ SỐ VN-INDEX

THE APPLICATION OF ARIMA MODEL TO VN-INDEX FORECAST

Tác giả: Nguyễn Hồ Diệu Uyên, [Nguyễn Thị Thanh Huyền](#)

Tóm tắt bằng tiếng Việt:

Thị trường chứng khoán luôn hấp dẫn các tổ chức và cá nhân đầu tư bởi mức sinh lợi cao. Các nhân tố tác động vào thị trường Việt Nam rất đa dạng và biến đổi khó lường. Bên cạnh đó, yếu tố hành vi chi phối phần lớn biến động thị trường. Vì vậy công việc dự báo Vn-Index gặp nhiều khó khăn. ARIMA là một công cụ dự báo hữu hiệu và phổ biến đối với dữ liệu chuỗi thời gian như Vn-Index. Việc dự báo được sự tăng giảm của Vn-Index giúp nhà đầu tư nhận biết chiều hướng biến động giá của các cổ phiếu để hoạch định chiến lược đầu tư phù hợp. Trong phạm vi bài báo này, tác giả tập trung dự báo chỉ số Vn-Index trong ngắn hạn bằng cách sử dụng mô hình ARIMA với phương pháp Box-jenkins theo 4 bước: nhận dạng, ước lượng, kiểm tra và dự báo. Và từ kết quả nghiên cứu sẽ đưa ra các khuyến cáo với nhà đầu tư về việc ứng dụng mô hình ARIMA.

Từ khóa: Thị trường chứng khoán; cổ phiếu; đầu tư; dự báo; mô hình ARIMA.

Tóm tắt bằng tiếng Anh:

The stock market always attracts organisations and individuals because of its high capability of profit generation. Factors affecting the Vietnam market are diverse and unpredictable. Besides, the behaviour factor controls most of the market fluctuation. Therefore, the forecast of Vn Index has met with difficulties. ARIMA is a efficient and popular tool to forecast the data in time chain like Vn Index. Forecasting the ups and downs of Vn Index helps investors acquire the fluctuating trend of stocks to plan their strategies appropriately. In this paper, the author focuses on forecasting the Vn Index in the short term using ARIMA model with Box-Jenkins methods in 4 steps: identifying, estimating, testing as well as forecasting, and gives advice to investors in applying ARIMA.

Key words: Stock market; stock; investment; predict; ARIMA.