

Kiểm định tính hiệu lực ngang giá sức mua (PPP) giữa đồng Việt Nam và đô la Mỹ

hồ Thủy Tiên

Đại học Tài chính – Marketing

Trần Thanh Tịch

Đại học Đồng Tháp

Nhận bài: 06/01/2017 – Duyệt đăng: 25/02/2017

Tóm tắt:

Nghiên cứu này tiến hành kiểm định sự tồn tại ngang giá sức mua giữa VN đồng và đô la Mỹ, với dữ liệu chuỗi thời gian về tỷ giá hối đoái, chỉ số giá tiêu dùng của VN và Mỹ trong giai đoạn từ tháng 01/2000 đến tháng 08/2016 của IMF. Dựa trên ứng dụng giải Nobel kinh tế năm 2003 của Clive W. J. Granger và Robert F. Engle về mô hình kinh tế chuỗi thời gian: Các biến số đồng liên kết và dị phương sai phụ thuộc tự hồi quy (mô hình ARCH). Kết quả nghiên cứu cho thấy ngang giá sức mua không tồn tại trong thời kỳ nghiên cứu và ngoài yếu tố lạm phát còn nhiều yếu tố khác tác động đến tỷ giá USD/VND. Qua đó tác giả đưa ra một số hàm ý chính sách hướng tới nâng cao năng lực cạnh tranh hàng hóa trong nước.

Từ khóa: Ngang giá sức mua PPP, điểm gãy cấu trúc, neo tỷ giá.

Abstract:

This research tests on the purchasing power parity exists between Vietnam dong and US dollar, with time series data on the exchange rate, consumer price index of Vietnam and the US in the period from 01/2000 to 08/2016 of IMF. Based on the application of the Nobel Prize in economics, 2003, W. J. Clive Granger and Robert F. Engle economic model time series: the co-linked variable and dependent allergic variance autoregression (ARCH model). Research results show that purchasing power parity does not exist during the research and external inflation factors are many factors affecting the USD/VND. Through which the author gives some policy implications towards enhancing the competitiveness of domestic goods.

Key words: Power of Purchasing Parity (PPP).