

**ĐẠI HỌC QUỐC GIA TP. HCM**  
**TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ - LUẬT**  
..........

**PHÂN TÍCH SỰ BIẾN ĐỘNG GIÁ VÀ XÁC ĐỊNH HỆ SỐ CẠNH TRANH CỦA MỘT SỐ  
NÔNG SẢN VIỆT NAM  
TRÊN THỊ TRƯỜNG THẾ GIỚI**

**LUẬN ÁN TIẾN SĨ KINH TẾ**

**Thành phố Hồ Chí Minh**

**Năm 2017**

## MỞ ĐẦU

### 1. Tính cần thiết của đề tài

Cho dù vẫn còn nhiều tranh cãi về lợi ích của các quốc gia trong quá trình hội nhập kinh tế toàn cầu, thương mại quốc tế vẫn ngày càng tăng trưởng. Là một trong những quốc gia xuất khẩu nông sản hàng đầu trên thế giới, Việt Nam đã có quan hệ thương mại với hơn 200 quốc gia và ngày càng phụ thuộc nhiều hơn vào nền kinh tế thế giới. Đối với Việt Nam, tính trong năm 2015, nhờ vào xuất khẩu nông-lâm-thủy-hải sản ra các nước đã mang lại trị giá xuất khẩu hơn 30 tỷ đô la chiếm 14% trong tổng giá trị xuất khẩu của tất cả các mặt hàng ngoại trừ xăng dầu và khoáng sản (Tổng cục Thống kê, 2016). Nếu xét theo lý thuyết kinh tế vi mô, giá của hàng hóa này sẽ bị ảnh hưởng bởi giá của các hàng hóa liên quan cũng như bởi các ảnh hưởng đến cung và cầu của chính hàng hóa đó, chẳng hạn như giá dầu có hiệu ứng lan tỏa lên thị trường cà phê và ca cao (Maurice và Davis, 2011). Một vấn đề khác trong cạnh tranh thương mại là cạnh tranh về giá hay về lượng. Theo Carlton và Perloff (2000), nếu không có người dẫn dắt thị trường, sẽ rất khó khăn khi xem xét giá được quyết định như thế nào nếu các doanh nghiệp ưu tiên cạnh tranh về lượng (mô hình Cournot) hơn cạnh tranh về giá (mô hình Bertrand). Tuy nhiên, Dufwenberg và Gneezy (1999) cho rằng các giải pháp từ mô hình cạnh tranh giá rất hiệu quả khi thị trường có nhiều hơn hai người (hai quốc gia) tham gia xuất khẩu. Chịu ảnh hưởng từ các yếu tố tác động đến sự biến động giá nông sản cũng như đến hệ số cạnh tranh về giá giữa một số nước xuất khẩu nông sản hàng đầu trên thế giới là vấn đề cần thiết đối với mỗi quốc gia. Việt Nam cũng không ngoại lệ khi xuất khẩu nông sản cũng ảnh hưởng đến hơn 15 triệu hộ gia đình sản xuất.

Xuất phát từ vai trò quan trọng của giá nông sản trong bối cảnh hội nhập quốc tế, nhằm giúp cho những nông dân trực tiếp sản xuất, các doanh nghiệp chế biến và xuất khẩu nông sản, các nhà lập chính sách và các bên có liên quan có cơ sở khoa học đưa ra các biện pháp giảm thiểu rủi ro từ sự biến động giá và nâng cao khả năng cạnh tranh trên thị trường thế giới, luận án đã kế thừa những kết quả từ các nghiên cứu trước và chọn lọc những phương pháp nghiên cứu phù hợp để xây dựng các mô hình kinh tế lượng và phân tích tính cạnh tranh thông qua việc xác định các hệ số cạnh tranh của nông sản Việt Nam, đặc biệt là hai mặt hàng quan trọng là gạo và cà phê.

### 2. Mục tiêu nghiên cứu và câu hỏi nghiên cứu

#### 2.1. Mục tiêu nghiên cứu

Mục tiêu tổng quát của luận án là xác định các yếu tố ảnh hưởng đến giá nông sản xuất khẩu và đo lường hệ số cạnh tranh về giá của một số nước xuất khẩu chủ lực so với Việt Nam. Để thực hiện mục tiêu tổng quát của nghiên cứu, luận án xây dựng các mục tiêu cụ thể cần phải thực hiện như sau: (i) Xem xét sự biến động giá và xác định các yếu tố ảnh hưởng đến sự biến động giá nông sản xuất khẩu, (ii) Đo lường hệ số cạnh tranh về giá giữa một số quốc gia xuất khẩu chủ lực, (iii) Thông qua hiệu ứng giá-lượng và RCA, từ đó đưa ra nhận xét khả năng cạnh tranh của nông sản Việt Nam, (iv) Định hướng giải pháp nhằm giảm thiểu rủi ro do sự biến động giá và nâng cao khả năng cạnh tranh của mặt hàng nông sản xuất khẩu của Việt Nam.

#### 2.2. Câu hỏi nghiên cứu

Để đạt được mục tiêu trên, nghiên cứu tập trung trả lời những câu hỏi sau: (i) Diễn biến giá mặt hàng xuất khẩu của Việt Nam và của một số nước như thế nào? (ii) Trong các yếu tố làm giá biến động thì yếu tố nào có vai trò quan trọng nhất? (iii) Hệ số cạnh tranh về giá giữa một số quốc gia so với Việt Nam như thế nào? (iv) Khả năng cạnh tranh của nông sản Việt Nam so với các nước như thế nào? (v) Việt Nam cần phải làm gì để giảm thiểu rủi ro do giá biến động và đồng thời nâng cao năng lực cạnh tranh?

### 3. Đối tượng nghiên cứu và phạm vi nghiên cứu

#### 3.1. Đối tượng nghiên cứu

Đối tượng nghiên cứu của luận án là giá xuất khẩu theo mô hình Bertrand; Hiệu ứng giá và lượng; Hệ số cạnh tranh về giá trên thị trường thế giới. Hai mặt hàng xuất khẩu được phân tích chính là gạo và cà phê của Việt Nam trên thị trường thế giới.

### 3.2. Phạm vi nghiên cứu

*Phạm vi nội dung:* Nghiên cứu các yếu tố ảnh hưởng đến giá xuất khẩu nông sản và cạnh tranh giữa các quốc gia thông qua hệ số cạnh tranh về giá xuất khẩu.

*Phạm vi thời gian:* Số liệu thứ cấp được phân tích trong giai đoạn 26 năm đối với mặt hàng gạo (từ năm 1991-2016) và 26 năm đối với mặt hàng cà phê (từ năm 1991-2016). Ngoài ra thông tin sơ cấp từ việc phỏng vấn chuyên gia cũng được thực hiện trong 6 tháng từ tháng 3/2015 đến tháng 9/2015.

### 4. Phương pháp và dữ liệu nghiên cứu

Đề tài sử dụng các phương pháp định tính như phỏng vấn chuyên gia kết hợp với các phương pháp định lượng như thống kê mô tả, kiểm định tính dừng, kiểm định nhân quả, kiểm định đồng liên kết, mô hình sai phân và mô hình ECM với các dữ liệu định lượng theo chuỗi thời gian được thu thập từ UN-Comtrade, IMF, Tổng cục Hải quan, Trang tin Thương mại Bộ NN&, FAO, ICO.

### 5. Những đóng góp mới của luận án

*Thứ nhất,* luận án ứng dụng các dạng mô hình hồi qui bao gồm ECM để ước lượng tác động trong ngắn hạn và dài hạn của các yếu tố ảnh hưởng đến sự biến động giá xuất khẩu của Việt Nam.

*Thứ hai,* luận án xác định hệ số cạnh tranh về giá giữa một số quốc gia xuất khẩu chủ lực so với Việt Nam.

*Thứ ba,* luận án thông qua hiệu ứng giá và lượng nhằm xác định nhóm các quốc gia đạt giá trị xuất khẩu dựa vào hiệu ứng giá và nhóm quốc gia dựa vào hiệu ứng lượng.

*Thứ tư,* luận án đề xuất một số gợi ý chính sách nhằm giúp cho Việt Nam giảm thiểu rủi ro do sự biến động giá và nâng cao khả năng cạnh tranh của nông sản Việt Nam trên thị trường thế giới.

### 6. Ý nghĩa khoa học của đề tài

Xây dựng tổng quan nghiên cứu về sự biến động giá xuất khẩu và hệ số cạnh tranh. Định hướng cho nghiên cứu hiện tại và những nghiên cứu liên quan trong lĩnh vực xuất khẩu nông sản, cạnh tranh sản phẩm giữa các quốc gia.

Tổng hợp các nguyên nhân chính làm cho giá nông sản xuất khẩu biến động rất mạnh trong thời gian qua; lý luận và xác định được hiệu ứng giá và hiệu ứng lượng trong hoạt động xuất khẩu nông sản của các quốc gia chính yếu trên thế giới.

Hệ thống hóa các phương pháp nghiên cứu trong lĩnh vực này và đề xuất phương pháp nghiên cứu liên quan đến biến động giá và hệ số cạnh tranh.

Căn cứ trên quan hệ nhân quả, xác định được giá của quốc gia nào ảnh hưởng mạnh nhất đến giá mặt hàng nông sản xuất khẩu của Việt Nam.

Xây dựng chỉ tiêu và cách tính hệ số cạnh tranh về giá giữa một số quốc gia xuất khẩu chủ lực trên thị trường thế giới.

Xây dựng được mô hình hồi qui phân tích về giá xuất khẩu, làm cơ sở tham khảo cho các nghiên cứu trong lĩnh vực liên quan.

#### 6.1. Về mặt lý thuyết

Bổ sung cơ sở lý luận cho mô hình lý thuyết lượng hóa về các yếu tố ảnh hưởng đến giá xuất khẩu của mặt hàng nông sản trên thị trường thế giới và lý thuyết hệ số cạnh tranh về giá góp phần hoàn thiện khung phân tích giá xuất khẩu và hệ số cạnh tranh về giá giữa các quốc gia xuất khẩu nông sản chủ lực trên thế giới.

Luận án làm vững chắc cơ sở khoa học trong việc vận dụng mô hình lý thuyết lượng hóa này cho trường hợp các quốc gia xuất khẩu chủ lực trên thị trường thế giới và cung cấp thêm chỉ tiêu phân tích về cạnh tranh giá.

#### 6.2. Về mặt thực tiễn

Mô tả được thực trạng và diễn biến trong quá khứ về biến động giá và hệ số cạnh tranh nhằm làm cơ sở cho việc định hướng các chiến lược phát triển trong thời gian tới.

Giúp cho các cơ quan quản lý nhà nước, các doanh nghiệp xác định được vấn đề then chốt và những chiến lược hoặc những yếu tố quan trọng cần phát huy nhằm mang lại hiệu quả cho hoạt động xuất khẩu.

Phân tích và đo lường sự ảnh hưởng của các yếu tố đến sự biến động giá và tính toán chỉ số cạnh tranh giữa các quốc gia để đề xuất các giải pháp nhằm giảm thiểu rủi ro do biến động giá và nâng cao năng lực cạnh tranh của mặt hàng nông sản xuất khẩu của Việt Nam trên thị trường thế giới.

Thông qua hiệu ứng giá-lượng và sự biến động giá thị trường của các quốc gia xuất khẩu nông sản chủ lực trên thế giới giúp cung cấp thông tin cho các nhà quản lý thấy được và xác định chiến lược phát triển thương mại phù hợp.

Luận án là tài liệu tham khảo có giá trị khoa học cho các nhà nghiên cứu, nhà quản lý về vấn đề xuất khẩu, giá xuất khẩu và cạnh tranh.

## CHƯƠNG 1

### TỔNG QUAN TÌNH HÌNH NGHIÊN CỨU VÀ QUY TRÌNH NGHIÊN CỨU

#### 1.1. Tổng quan tình hình nghiên cứu liên quan đến đề tài

##### 1.1.1. Các công trình nghiên cứu về thương mại quốc tế

*1.1.1.1. Các nghiên cứu ngoài nước*

*1.1.1.2. Các nghiên cứu trong nước*

##### 1.1.2. Các công trình nghiên cứu liên quan đến sự biến động giá

*1.1.2.1. Sự biến động giá nông sản*

Từ năm 1981 đến năm 2014, giá cà phê thế giới đã trải qua những biến động mạnh mẽ với những cú tăng đột ngột hoặc tụt dốc trong thời gian dài. Tuy nhiên, giá cà phê thế giới trở nên không ổn định và khó dự đoán hơn trong hơn ba thập niên vừa qua (Andrew và James, 2002). Trong các lý thuyết liên quan đến đặc điểm giá nông sản thì điểm đáng lưu ý là giá vận động có tính mùa vụ, tính chu kỳ và có độ trễ theo thời gian. Nghiên cứu của Tomek và cộng sự (2003) đã đưa thêm bằng chứng thực tiễn về vấn đề này. Đặc điểm của giá nông sản là biến động một cách ngẫu nhiên và có hệ thống. Giá của ngày hôm nay có liên hệ với giá ngày hôm qua và cả những ngày trước đó, hay nói cách khác giá nông sản theo dữ liệu chuỗi thời gian có tương quan với nhau. Đối với mặt hàng gạo xuất khẩu của Iran, giá có chu kỳ biến động là 3 năm theo nghiên cứu của Zarenejad (2012). Ngoài ra, nghiên cứu của Nguyễn Văn Giáp (2010) cho thấy có sự liên kết về giá giữa các thị trường đã làm cho sự biến động giá có tính liên hoàn đối với mặt hàng cá da trơn của Mỹ.

*1.1.2.2. Các yếu tố tác động đến sự biến động giá nông sản*

Những nghiên cứu điển hình như nghiên cứu của Maurice và Davis (2011); Molina và các cộng sự (2013); Zarenejad (2012); Wang, Yang và Sun (2012); Chulaphan và các cộng sự (2013); Deaton (1989). Các nghiên cứu này xác định các yếu tố làm giá biến động như giá gạo xuất khẩu của các nước có ảnh hưởng lẫn nhau và tác động lên giá gạo của nước khác trên thị trường gạo chất lượng cao Chulaphan và các cộng sự (2013). Tỷ giá cũng là một yếu tố quan trọng ảnh hưởng đến sự biến động giá xuất khẩu nông sản, từ kết quả cấu trúc mô hình giá và sử dụng các chức năng phản ứng thúc đẩy nhằm dự báo những tác động về giá và từ đó đề xuất một số giải pháp giảm những rủi ro khi giá biến động (Wang, Yang và Sun, 2012). Ảnh hưởng của tỷ giá cũng được tìm thấy trong kết quả nghiên cứu của Zarenejad (2012) về trường hợp xuất khẩu gạo của Iran. **Công trình nghiên cứu của Maurice và Davis (2011) xác định các hàng hóa liên quan có ảnh hưởng đến sự biến động giá quá mức của hai hàng hóa có tầm quan trọng đối với các nước đang phát triển phụ thuộc vào hàng hóa (CDDCs).**

##### 1.1.3. Các công trình nghiên cứu về cạnh tranh và hệ số cạnh tranh

*1.1.3.1. Các công trình nghiên cứu về cạnh tranh*

Các nghiên cứu trên thế giới đề cập đến ưu và nhược điểm của mô hình cạnh tranh lượng Cournot và mô hình cạnh tranh về giá Bertrand như nghiên cứu của Ymkella, Unnevehr và Garcia (1994); Deodhar và Sheldon (1997); Singh và Vives (1984); Kolstad và Burriss (1986); Carter và MacLaren

(1997); Ghoshray (2008); Lee và Kennedy (2006); Carlton và Perloff (2000); Singh và Vives (1984); Hackner (2000) cho rằng không có chứng cứ nào cho thấy cạnh tranh về lượng hiệu quả hơn cạnh tranh về giá và thậm chí các nghiên cứu của Carlton và Perloff (2000) và Singh và Vives, (1984) đều đánh giá cao cạnh tranh về giá hơn cạnh tranh về lượng. Theo nghiên cứu của Singh và Vives (1984) về cạnh tranh giá và lượng, các tác giả đã kết luận, với cấu trúc đường cầu tuyến tính, cạnh tranh Bertrand hiệu quả hơn cạnh tranh Cournot cho dù đặc tính của hàng hóa là thay thế hay bổ sung và phụ thuộc mức độ cân đối trong cấu trúc đường cầu.

### 1.1.3.2. Những nghiên cứu về hệ số cạnh tranh

Theo Aghion và các cộng sự (2001), hệ số cạnh tranh là hệ số co giãn chéo giữa những sản phẩm. Tương tự theo Pierre Mohnen và Thijs ten Raa (2003), hệ số cạnh tranh là hệ số co giãn thay thế giữa các sản phẩm.

Theo các mô hình toán kinh tế thì hệ số co giãn chéo là tỷ lệ phần trăm thay đổi giữa mặt hàng được xuất khẩu từ quốc gia này so với mặt hàng được xuất khẩu từ quốc gia khác.

$$\varepsilon_i = \frac{\% \Delta Y}{\% \Delta X_1} = \frac{\partial Y}{\partial X_1} * \frac{X_1}{Y} = \beta_i$$

Trong đó, Y là lượng xuất khẩu từ quốc gia A và  $X_1$  là giá xuất khẩu từ nước khác.

Những mô hình nghiên cứu về cạnh tranh bắt nguồn từ lĩnh vực xã hội học, xuất phát từ nghiên cứu của Lotka (1925), tiếp đến là nghiên cứu của Volterra (1926) căn cứ trên mô hình toán học, các tác giả đã mô tả sự cạnh tranh về nguồn lợi giữa các đối thủ trong cùng môi trường. Mô hình cạnh tranh về tăng trưởng của các loài của Lotka-Volterra (1987), ngoài ra còn có nghiên cứu của Malthus (1987). Từ mô hình trên, các nhà nghiên cứu đã đẩy mạnh áp dụng vào nhiều lĩnh vực khác nhau trong đời sống xã hội như lĩnh vực sinh học, xã hội học, vật lý.

## 1.2. Khái quát chung về những kết quả nghiên cứu liên quan đến đề tài và khoảng trống cho nghiên cứu

Các công trình nghiên cứu của nước ngoài áp dụng phương pháp định lượng với nhiều mô hình phân tích đa dạng. Tuy nhiên, các nghiên cứu này không nghiên cứu riêng cho trường hợp Việt Nam và cũng đơn thuần một kỹ thuật phân tích, chưa phối hợp với các phương pháp. Ở Việt Nam, phần lớn công trình nghiên cứu áp dụng phương pháp thống kê mô tả và phân tích tổng hợp. Từ việc nghiên cứu tổng quan các công trình đã được thực hiện, luận án tiếp thu và kế thừa những điểm sau đây:

*Thứ nhất*, một số nghiên cứu ở nước ngoài đã xây dựng mô hình giá cho một số mặt hàng nông sản và cũng đo lường tác động của một số yếu tố ảnh hưởng đến giá.

*Thứ hai*, các nghiên cứu nước ngoài đo lường ảnh hưởng của các yếu tố đến giá xuất khẩu, các yếu tố điển hình: tỷ giá hối đoái, giá của các quốc gia ảnh hưởng lẫn nhau, giá của các hàng hóa liên quan, giá nhiên liệu (giá dầu), yếu tố thời gian trong hoạt động xuất khẩu và biến động giá.

*Thứ ba*, quan điểm cạnh tranh về giá (Bertrand) hay cạnh tranh về lượng (Cournot) vẫn còn tranh cãi giữa các nhà khoa học, tuy nhiên luận án kế thừa quan điểm của những nghiên cứu gần đây cho rằng cạnh tranh Bertrand hiệu quả hơn Cournot.

*Thứ tư*, luận án kế thừa những kết quả nghiên cứu trong nước về việc đánh giá hoạt động xuất khẩu theo cơ cấu và biến động thị trường, đồng thời phân tích định tính các yếu tố làm cho giá biến động như chính sách của Chính phủ hay khí hậu thời tiết.

Nghiên cứu các công trình trong và ngoài nước liên quan đến biến động giá và hệ số cạnh tranh của mặt hàng nông sản xuất khẩu của Việt Nam, luận án rút ra những khoảng trống sau:

(1) Các công trình nghiên cứu ở nước ngoài chưa xây dựng mô hình nghiên cứu cho hai mặt hàng gạo, cà phê xuất khẩu từ Việt Nam ra thị trường thế giới.

(2) Các nghiên cứu trong nước chưa đề cập đến các yếu tố làm ảnh hưởng đến giá xuất khẩu của Việt Nam như giá của các hàng hóa liên quan, tỷ giá hối đoái, giá nhiên liệu, thu nhập bình quân đầu người của thế giới.

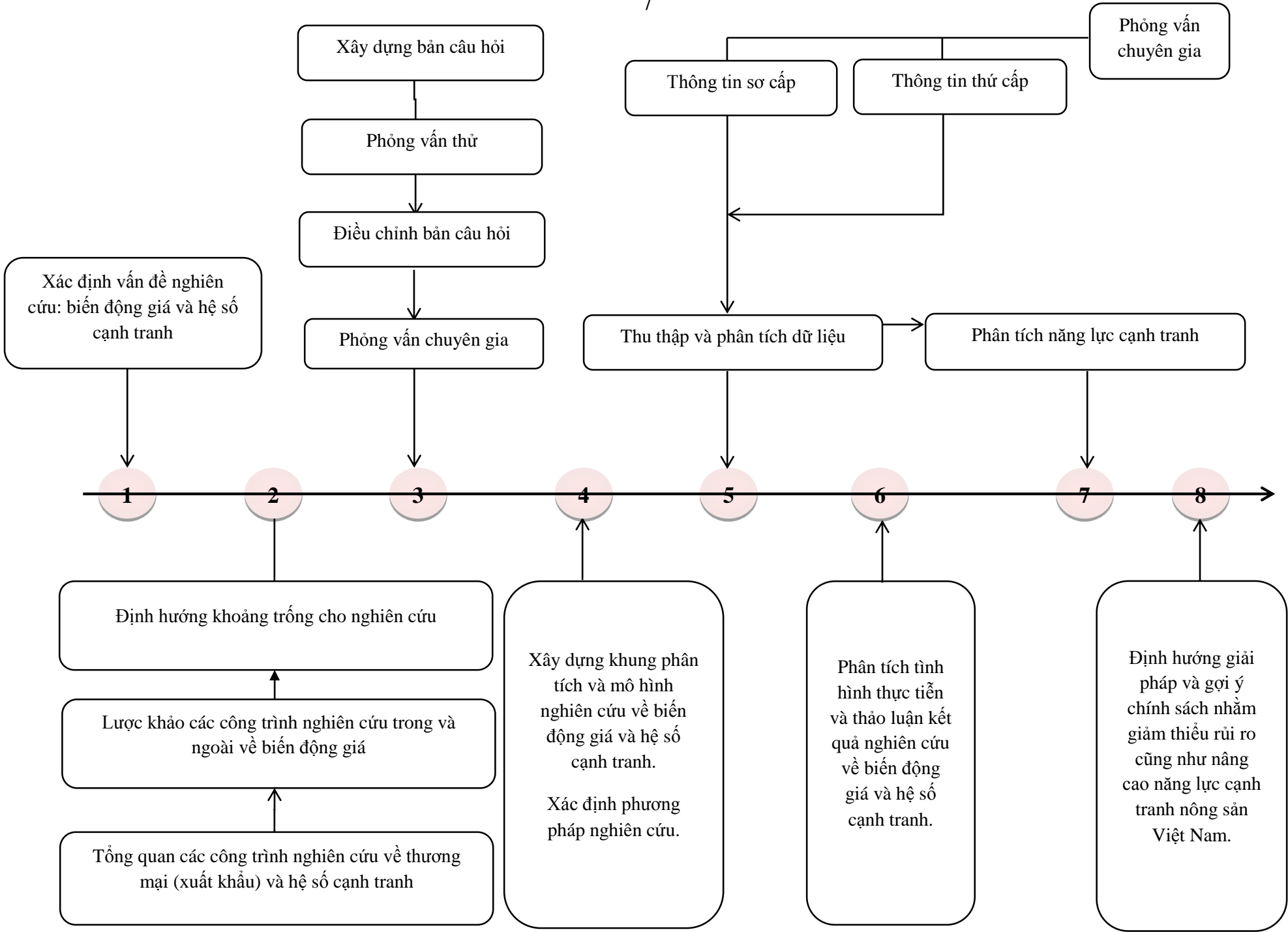
(3) Các công trình nghiên cứu trong nước chưa xây dựng được mô hình lượng hóa tác động của các yếu tố ảnh hưởng đến sự biến động giá của hai mặt hàng xuất khẩu của Việt Nam là gạo và cà phê.

(4) Khi phân tích về tác động của các quốc gia cạnh tranh đến hàng hóa Việt Nam, các nghiên cứu cũng chưa tách biệt những tác động trong ngắn hạn và dài hạn cũng như những thay đổi ngẫu nhiên theo thời gian của giá xuất khẩu.

(5) Về phương pháp nghiên cứu, các công trình trong nước chỉ áp dụng các phương pháp so sánh, tổng hợp và phương pháp thống kê mô tả, còn ít nghiên cứu sử dụng phương pháp định lượng áp dụng lý thuyết kinh tế vi mô và thương mại quốc tế để phân tích.

(6) Đặc biệt, nghiên cứu sử dụng giá trị xuất khẩu để tính hiệu ứng giá và lượng của các quốc gia xuất khẩu dẫn đầu trên thế giới cũng chưa được áp dụng nhiều ở trong và ngoài nước.

### **1.3. Quy trình nghiên cứu**



**CHƯƠNG 2**  
**CƠ SỞ LÝ THUYẾT VÀ MÔ HÌNH NGHIÊN CỨU SỰ BIẾN ĐỘNG GIÁ**  
**VÀ HỆ SỐ CẠNH TRANH VỀ GIÁ CỦA NÔNG SẢN XUẤT KHẨU**  
**VIỆT NAM TRÊN THỊ TRƯỜNG THẾ GIỚI**

**2.1. Những vấn đề cơ bản về giá, hiệu ứng giá-lượng và hệ số cạnh tranh**

**2.1.1. Khái niệm giá**

Khái niệm giá

Mô hình Cobweb tuyến tính

**2.1.2. Hiệu ứng giá và hiệu ứng lượng**

Việc tính toán hiệu ứng giá và lượng trong tăng trưởng giá trị xuất khẩu là một bài toán dựa trên công thức như sau:

$$\underbrace{P_t X_t - P_{t-1} X_{t-1}}_A = \underbrace{(P_t - P_{t-1}) X_{t-1}}_B + \underbrace{(X_t - X_{t-1}) P_{t-1}}_C + \underbrace{(P_t - P_{t-1})(X_t - X_{t-1})}_D$$

Trong đó:

t: chỉ thời điểm xuất khẩu

X: khối lượng mặt hàng xuất khẩu

P: giá mặt hàng xuất khẩu

A: thay đổi giá trị xuất khẩu của năm t so với năm trước (t-1)

B: hiệu ứng giá, tức phần tăng (giảm) giá trị xuất khẩu là nhờ “được (mất)” giá

C: hiệu ứng lượng, tức phần tăng (giảm) giá trị xuất khẩu so với năm trước là do lượng xuất khẩu nhiều (ít) hơn

D: hiệu ứng gộp (hoặc thừa), không tách rời được giá và lượng

Căn cứ vào hiệu ứng giá và lượng có thể xác định được những quốc gia xuất khẩu dựa nhiều vào số lượng hàng hóa xuất khẩu hay những quốc gia dựa nhiều vào giá xuất khẩu để gia tăng giá trị xuất khẩu về cho quốc gia mình.

**2.2. Cơ sở lý luận để phân tích giá, cạnh tranh và thương mại**

**2.2.1. Nghiên cứu lý thuyết về thương mại**

2.2.1.1. Lý thuyết lợi thế tuyệt đối (Absolute Advantage theory)

2.2.1.2. Lý thuyết lợi thế tương đối (Comparative Advantage theory)

Lợi thế so sánh hiện hữu RCA (Revealed Comparative Advantage) được tính bằng cách chia thị phần xuất khẩu của một hàng hoá (hoặc nhóm hàng hoá) của một quốc gia **trong tổng xuất khẩu hàng hoá đó (hoặc nhóm hàng hoá đó) của quốc gia đó trên thị trường thế giới (hoặc một tập hợp các quốc gia) cho thị phần xuất khẩu hàng hoá đó của thế giới trong tổng số hàng hóa xuất khẩu của thế giới.**

Công thức như sau:

$$RCA_i = (X_{Ci}/X_c)/(X_{wi}/X_w)$$

Trong đó:

$X_{Ci}$ : Giá trị xuất khẩu hàng hóa i của một quốc gia.

$X_c$ : Tổng giá trị xuất khẩu của một quốc gia

$X_{wi}$ : Giá trị xuất khẩu hàng hóa i của thế giới

$X_w$ : Tổng giá trị xuất khẩu của thế giới

Nếu  $RCA_i > 1$ , tức là  $X_{Ci}/X_c > X_{wi}/X_w$ : Quốc gia đó được xem là có lợi thế so sánh đối với hàng hóa i.

Nếu  $RCA_i < 1$ , tức là  $X_{Ci}/X_c < X_{wi}/X_w$ : Quốc gia đó được xem là không có lợi thế so sánh đối với hàng hóa i.

2.2.1.3. Lý thuyết của Hechsher-Ohlin

2.2.1.4. Lý thuyết về lợi thế cạnh tranh quốc gia của Micheal Porter

**2.2.2. Nghiên cứu lý thuyết về giá**

2.2.2.1. Lý thuyết cổ điển

2.2.2.2. Lý thuyết cận biên

2.2.2.3. Lý thuyết tân cổ điển

**2.2.3. Nghiên cứu lý thuyết về cạnh tranh**

Các mô hình cạnh tranh



Những lý thuyết về cạnh tranh không hoàn hảo tập trung vào 3 chiến lược cạnh tranh được đặt tên theo người đề xuất như Cournot, Stackelberge và Bertrand. Nhiều nhà nghiên cứu trên thế giới ưa thích mô hình Cournot hơn Bertrand vì cho rằng với chiến lược Cournot, nhà sản xuất sẽ có được giá cao hơn và hiệu quả kinh doanh tốt hơn khi sử dụng chiến lược Bertrand.

Cạnh tranh giá xảy ra khi sản phẩm có sự khác biệt, hai hãng bán sản phẩm có sự khác biệt, cầu của mỗi hãng phụ thuộc vào giá của hãng và giá của đối thủ. Hai hãng đồng thời chọn giá của mình và mỗi hãng xem giá của hãng kia là đã cho. Đường phản ứng của hãng 1 cho giá tối đa hóa lợi nhuận của hãng là một hàm số của giá mà hãng hai đã đặt ra. Cân bằng Nash là điểm cân bằng của hai đường phản ứng này. Từ hàm phản ứng Bertrand có thể thiết lập hàm phân tích giá, giá xuất khẩu của Việt Nam là hàm số giá từ các quốc gia khác (các quốc gia có ảnh hưởng đến giá của Việt Nam).

### 2.3. Đề xuất khung phân tích về giá và hệ số cạnh tranh

Trong nghiên cứu này, luận án tập trung vào cơ sở lý thuyết và tình hình nghiên cứu về sự cạnh tranh giá vì đặc điểm của sản xuất nông nghiệp của mỗi quốc gia phụ thuộc nhiều vào yếu tố tự nhiên, năng lực sản xuất có giới hạn, nên không thể sử dụng chiến lược Cournot (cạnh tranh về lượng) để cạnh tranh nhau trên thị trường thế giới. Do đó, các quốc gia thường sẽ cạnh tranh về giá. Thêm nữa, đối với nông sản, khi nguồn gốc xuất xứ khác nhau thì sản phẩm có sự khác biệt, chứ không đồng nhất về chất. Theo các nghiên cứu ở trên, với các mặt hàng nông sản giống nhau nhưng có thể phân biệt thông qua nguồn gốc xuất xứ, chất lượng khác nhau, các quốc gia xuất khẩu nông sản sẽ có khuynh hướng sử dụng chiến lược Bertrand (cạnh tranh về giá) để đạt được hiệu quả hơn.

Luận án tiếp cận góc độ cạnh tranh Bertrand, giá từ quốc gia này là hàm phản ứng giá từ quốc gia khác, thêm nữa mô hình giá được phát triển từ mô hình cung và cầu (thị trường ở trạng thái cân bằng).

Dù vậy, một số nghiên cứu chỉ ra rằng khi xem xét dưới góc độ hành vi người tiêu dùng nhằm phân tích sự cạnh tranh giữa các doanh nghiệp như nghiên cứu của Harrington và Chang (2005) và nghiên cứu của Fedinandova (2003) thì có thể ảnh hưởng một cách nghiêm trọng đến kết quả của mô hình Bertrand trong trường hợp người tiêu dùng “chậm chạp” tìm kiếm được giá tốt nhất. Trong khi nghiên cứu khác như nghiên cứu của Hehenkamp (2002) và Vilà (2007), bên cạnh việc đề cập hành vi người tiêu dùng thì các tác giả cũng đề cập đến khía cạnh về sự cạnh tranh giữa các doanh nghiệp, trong đó các doanh nghiệp sẽ xác định giá hay xây dựng chiến lược giá như một trò chơi được lặp đi lặp lại. Với hai hướng tiếp cận này đã giúp cho các nghiên cứu gần đây giảm nhẹ các điều kiện (các giả định) khi sử dụng mô hình Bertrand nhưng vẫn đạt được kết quả tốt.

Từ các lý thuyết trên, luận án lựa chọn theo cách áp dụng mô hình phân tích của Stone (1954) và được Muellbauer (1980), Asche (2005) mở rộng cho các mặt hàng, trong đó có đề cập đến tính biến động của mô hình, bao gồm xem xét những tác động trong ngắn hạn và dài hạn, thể hiện qua biến trễ của mô hình, do đó mô hình hiệu chỉnh sai số được đề xuất. Bên cạnh đó, các tác giả cũng xem xét đến ảnh hưởng của chính sách vĩ mô dựa trên dữ liệu chuỗi thời gian.

Mô hình ECM có dạng như sau:

$$\Delta \ln q_{it} = \alpha_i + \sum_{k=1}^{r-1} C_{ik} \Delta \ln q_{it-k} + \sum_j \sum_{l=0}^{s-1} E_{ijl} \ln p_{jt-l} + \sum_{l=0}^{s-1} E_{il} \ln X_{t-l} - \omega (\ln q_{t-r} - \sum_j \eta_{ij} \ln p_{jt-s} - \eta_i \ln X_{t-s})$$

Luận án xuất phát từ trạng thái cân bằng của thị trường (Equilibrium status)  $Q_d = Q_s$

Trong đó: giá của hàng hóa đó ( $P_x$ ), thu nhập ( $I$ ), giá cả hàng hóa liên quan ( $P_R$ ) bao gồm giá của các nước xuất khẩu mạnh về mặt hàng này, dân số ( $P_0$ ). Mỗi quan hệ của hàm cầu được khái quát qua hàm số sau:  $Q_d = f(P_x, I, P_R, P_0)$

$$Q_d = a + bP_x + cI + d_j \sum_1^j P_{Rj} + eP_0$$

Các yếu tố ảnh hưởng đến đường cung bao gồm giá cả của hàng hóa và dịch vụ trên thị trường ( $P_x$ ), chi phí sản xuất ( $P_{oil}$ ), chính sách của Nhà nước ( $GP$ ), điều kiện tự nhiên ( $W$ ) và một số yếu tố khác quan khác, đối với hàng hóa xuất khẩu thì giá xuất khẩu bị ảnh hưởng bởi tỷ giá.

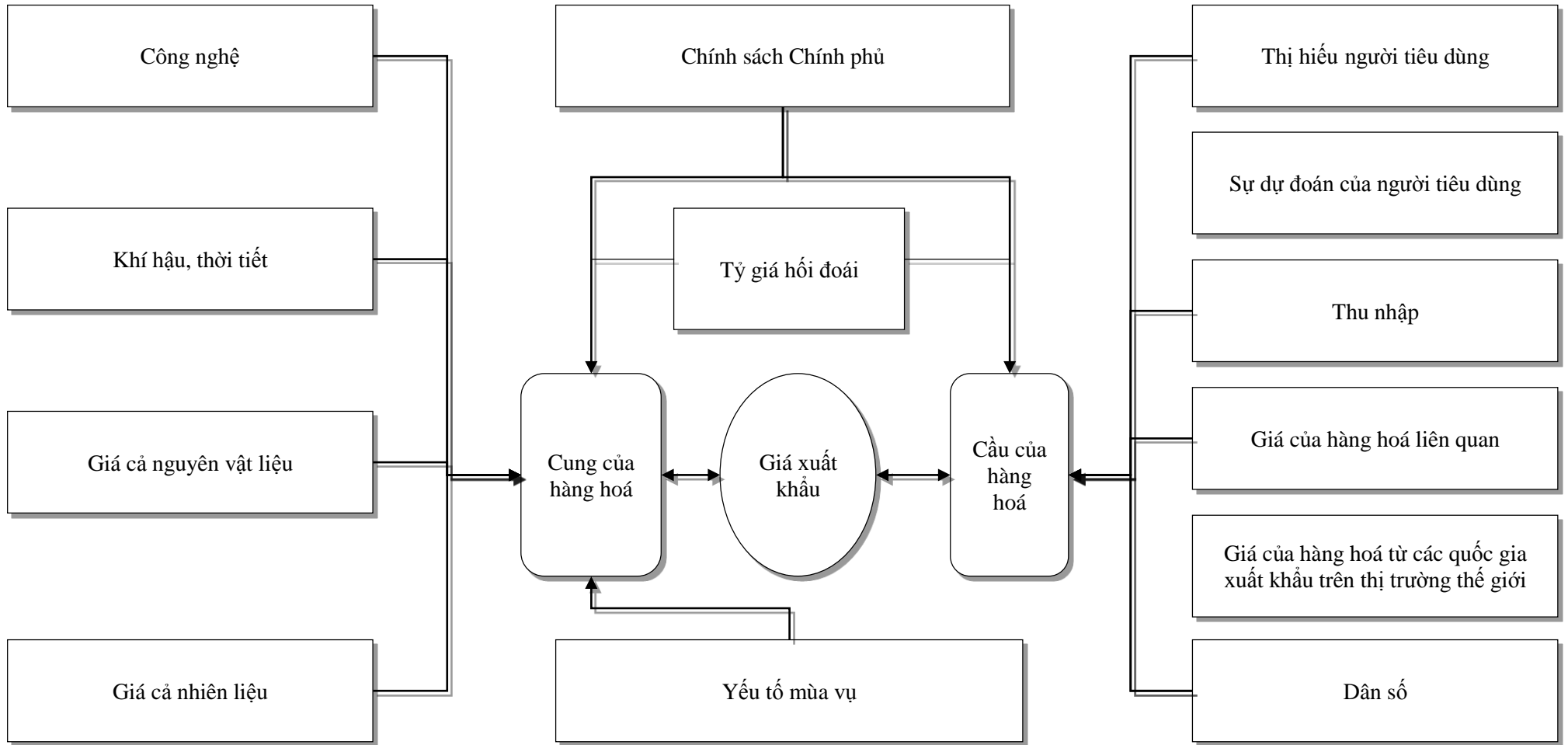
Lượng cung và giá cả có mối quan hệ cùng chiều. Giá cả cao thì lượng cung lớn và ngược lại giá cả thấp thì lượng cung giảm.

$$Q_s = f(P_x, E_x, P_{oil}, GP, W)$$

$$Q_s = f(P) = a + bP_x + cE_x + dP_{oil} + eGP + fW$$

$$\rightarrow P_x = \beta_0 + \beta_1 I + \beta_2 P_0 + f_j \sum_{j=1}^n P_{Rj} + \beta_3 E_x + \beta_4 P_{oil} + \beta_5 GP + \beta_6 W$$

Trong đó: Xét ở góc độ thương mại quốc tế,  $P_j$  là giá các hàng hóa liên quan như giá của thế giới, giá của các quốc gia xuất khẩu chủ lực mặt hàng tương tự như của Việt Nam. Có nhiều yếu tố tác động đến sự biến động giá, tuy nhiên do đặc thù của nông sản, những yếu tố quan trọng ảnh hưởng đến giá thể hiện qua mô hình và hình vẽ dưới đây:



Hình 2.5. Mối liên hệ giữa các yếu tố, cung-cầu và giá xuất khẩu

Mô hình giá

$$P_X = \beta_0 + \beta_1 I + \beta_2 P_0 + f_j \sum_{j=1}^n P_{Rj} + \beta_3 E_X + \beta_4 P_{oil} + \beta_5 GP + \beta_6 W$$

Trong đó, các yếu tố ngoại sinh lần lượt: thu nhập (I), dân số (P<sub>0</sub>), giá các hàng hóa liên quan (P<sub>R</sub>), tỷ giá hối đoái (E<sub>X</sub>), giá xăng dầu (P<sub>oil</sub>), chính sách của chính phủ (GP) và điều kiện thời tiết (W). Mô hình này là cơ sở cho phân tích định tính.

Từ mô hình lý thuyết trên, luận án tham khảo các nghiên cứu trước từ đó đề xuất mô hình thực nghiệm sau:

$$\begin{aligned} \text{Ln}P_X = & \alpha_1 + \alpha_2 \text{Ln}E_X + \alpha_3 \text{Ln}P_{oil} + \alpha_4 \text{Ln}P_f + \beta_j \sum_{j=1}^n \text{Ln}P_j + \alpha_5 \text{Ln}P_1 + \alpha_6 \text{Ln}P_2 + \alpha_7 \text{Ln}I + \alpha_8 Q_1 \\ & + \alpha_9 Q_2 + \alpha_{10} Q_3 + e_i \end{aligned}$$

Các hệ số  $\alpha$ : cho thấy tác động của các yếu tố đến giá Việt Nam xuất khẩu

Trong đó, P<sub>X</sub> là giá của cà phê hoặc giá của gạo xuất khẩu của Việt Nam (biến phụ thuộc), các yếu tố (biến độc lập) trong mô hình được đề cập trong các nghiên cứu:

(1) Thu nhập(I): được đề cập trong lý thuyết kinh tế vi mô; Jaime Marquez và Carlyl McNeilly (1988); Julian Alston và James Chalfant (1987); Colin Carter, Donald MacLaren và Alper Yilmaz (1999); Angus Deaton (1989)

(2) Tỷ giá hối đoái (E<sub>X</sub>): được đề cập trong lý thuyết kinh tế quốc tế. Các học thuyết kinh tế ra đời mang tính kế thừa, bổ sung những khiếm khuyết của nhau. Như học thuyết của Adam Smith và David Ricardo đã bổ sung hoàn chỉnh những quan điểm của trường phái trọng thương đại diện là William Stafford, Thomas Mun. Theo đó, W. Stafford đã đề cập đến vấn đề tỷ giá hối đoái trong những chính sách của nhà nước; Henry Thompson (2001); Yang Wang, Jia Yang và Di Sun (2014); Kristinek và Anderson (2002); Keith Flury (2014)

(3) Giá dầu (P<sub>oil</sub>): được đề cập trong lý thuyết kinh tế vi mô; Mohcine Bakhat, Klaas Würzburg (2013); Chaudhuri, K. 2001; Chen, S.T., Kuo. H.I., Chen, C.C. 2010; Zilberman, D., Hochman, G., Rajagopal, D., Sexton, S., Timilsina, G. 2013; John Baffes (2008)

(4) Giá phân bón (P<sub>f</sub>): được đề cập trong lý thuyết kinh tế vi mô; Jayson Beckman và Stephanie Riche (2015); Craig Galbraith (2010)

(5) Giá các hàng hoá liên quan (P<sub>1</sub>, P<sub>2</sub>): được đề cập trong lý thuyết vi mô; Tomek và Robinson (2003); Capps và Havlicek (1984); Tomek và Kaiser (2003); Dick Durevall (2007); Maurice và Davis (2011); Pindyck và Rubinfeld (1999)

(6) Giá từ các nước cạnh tranh(P<sub>R</sub>): theo Ricardo giá cả trên thị trường cũng bị ảnh hưởng bởi sự cạnh tranh; Villas-Boas (1995); Koji Kubo (2013); Hiroshi Tsujii (1982); Colin Carter, Donald MacLaren và Alper Yilmaz (1999).

(7) Yếu tố mùa vụ (Q<sub>1</sub>, Q<sub>2</sub>, Q<sub>3</sub>): Henry Kinnucan (2003), Tomek và Robinson (2003); Engle và Quagrainie (2009)

### 2.3.2. Hệ số cạnh tranh về giá (competitive coefficient)

Theo Aghion và cộng sự (2001), trong điều kiện cạnh tranh về giá dẫn đến cân bằng Bertrand, hệ số thay thế giữa các doanh nghiệp đo lường mức độ cạnh tranh sản phẩm trong mỗi ngành. Hệ số cơ giãn của sự thay thế giữa các sản phẩm trong mô hình hàm cầu là hệ số cạnh tranh.

Trong nghiên cứu năm 2000 và 1997 của Aghion và cộng sự đều đo lường tác động của cạnh tranh thị trường sản phẩm đến sự tăng trưởng của các nhà máy. Lý thuyết hình thành mô hình phân tích của Aghion và cộng sự bắt đầu từ hàm cầu:

$$q_{Ai} = \frac{p_{Ai}^{\frac{1}{\alpha-1}}}{p_{Ai}^{\frac{\alpha}{\alpha-1}} + p_{Bi}^{\frac{\alpha}{\alpha-1}}} \quad \text{và} \quad q_{Bi} = \frac{p_{Bi}^{\frac{1}{\alpha-1}}}{p_{Bi}^{\frac{\alpha}{\alpha-1}} + p_{Ai}^{\frac{\alpha}{\alpha-1}}}$$

Trong đó:

Q: Sản lượng;

A, B: Đại diện cho hai nhà máy

Hệ số  $\alpha$  đo lường mức độ thay thế của hai hàng hóa của bất kỳ ngành công nghiệp.

Khi phân tích dưới góc độ cạnh tranh thị trường sản phẩm, mỗi nhà máy chỉ sử dụng một yếu tố đầu vào là lao động để tạo ra sản phẩm và chi phí sản xuất của hai nhà máy  $C_A$  và  $C_B$  không phụ thuộc vào số lượng sản phẩm được sản xuất. Sau khi so sánh giữa mô hình Cournot và Bertrand, các tác giả kết luận cạnh tranh về giá Bertrand là phù hợp và giả định các nhà máy cạnh tranh với nhau dựa vào giá. Từ hàm cầu, hệ số co giãn của cầu ở mỗi nhà máy  $j$  là:

$$\eta_j = \frac{1 - \alpha \lambda_j}{1 - \alpha}$$

Trong đó:

$$\lambda_j = p_j q_j \text{ là doanh thu của các nhà máy } \lambda_j = \frac{p_j^{\frac{\alpha}{\alpha-1}}}{p_A^{\frac{\alpha}{\alpha-1}} + p_B^{\frac{\alpha}{\alpha-1}}}$$

$$\text{Giá cân bằng của mỗi nhà máy: } p_j = \frac{1 - \alpha \lambda_j}{\alpha(1 - \lambda_j)} c_j$$

$$\text{Lợi nhuận cân bằng tương ứng: } \Pi_j = \frac{\lambda_j(1 - \alpha)}{1 - \alpha \lambda_j}$$

$$\text{Hệ số co giãn chéo trong hàm cầu là: } \left( \frac{1}{1 - \alpha} \right)$$

Như vậy hệ số thay thế, hệ số co giãn chéo  $\alpha$  đo lường mức độ cạnh tranh thị trường sản phẩm của mỗi nhà máy hay còn gọi là hệ số cạnh tranh.

Theo nghiên cứu của Muhammad và cộng sự (2013), các tác giả sử dụng mô hình Rotterdam (kế thừa từ nghiên cứu lý thuyết của Theil và Clements, 1987) nhằm xác định nhiều độ co giãn trong nghiên cứu của mình, bao gồm: hệ số co giãn theo chi phí và hệ số co giãn theo giá. Theo Muhammad và cộng sự (2013) hệ số co giãn theo giá cũng chính là hệ số co giãn chéo hay là hệ số cạnh tranh về giá giữa các quốc gia. Điều kiện nghiên cứu: thị trường nhập khẩu là một nước như Trung Quốc và các nước xuất khẩu chủ yếu Pháp, Úc, Mỹ.

Trong nghiên cứu hiện tại xác định nước nhập khẩu là duy nhất bao gồm tất cả các nước nhập khẩu trên thế giới, một số nước xuất khẩu chủ lực được đưa vào phân tích, giá định cùng một sản phẩm nhưng được xuất khẩu từ các quốc gia khác nhau nên không đồng nhất. Mô hình cạnh tranh của mặt hàng cà phê và gạo trên thế giới là cạnh tranh không hoàn hảo có nhiều quốc gia tham gia xuất khẩu và cạnh tranh giữa các quốc gia về giá (Bertrand). Hệ số cạnh tranh về giá giữa các quốc gia là phần trăm phản ứng về giá của quốc gia này so với phần trăm thay đổi về giá của quốc gia kia và nó cũng chính là hệ số co giãn trong hàm hồi qui về giá (mô hình giá chính là mô hình hàm cầu như trong nghiên cứu của Aghion nhưng nghịch đảo).

Khi áp dụng phương pháp phân tích định lượng cụ thể mô hình hồi qui của giá Việt Nam xuất khẩu như sau:

$$\begin{aligned} \text{Ln}P_X = & \alpha_1 + \alpha_2 \text{Ln}Ex + \alpha_3 \text{Ln}P_{oil} + \beta_j \sum_{j=1}^n \text{Ln}P_j + \alpha_5 \text{Ln}P_1 + \alpha_6 \text{Ln}P_2 + \alpha_7 \text{Ln}I + \alpha_8 Q_1 + \alpha_9 Q_2 \\ & + \alpha_{10} Q_3 + e_i \end{aligned}$$

$\beta_j$ : hệ số cạnh tranh giữa các quốc gia dẫn đầu thế giới so với Việt Nam hay còn gọi là hệ số co giãn thay thế;  $P_j$ : giá của các quốc gia xuất khẩu dẫn đầu thế giới.

## 2.4. Các giả định và giả thuyết nghiên cứu

### 2.4.1. Giả định

Cạnh tranh giữa các quốc gia xuất khẩu là cạnh tranh giá Bertrand, không đề cập đến cạnh tranh về lượng Cournot.

Thị trường gạo và cà phê trên thế giới là thị trường cạnh tranh không hoàn hảo.

Luận án áp dụng mức độ cạnh tranh ở cấp độ cạnh tranh sản phẩm của quốc gia này với quốc gia khác với loại sản phẩm tương đồng.

Mô hình giá được xây dựng ở trạng thái cân bằng của thị trường thế giới.

### 2.4.2. Giả thuyết nghiên cứu

Giả thuyết 1 ( $H_1$ ): “Giá xuất khẩu từ các nước được kỳ vọng có tác động dương đến giá xuất khẩu của Việt Nam”.

Giả thuyết 2 ( $H_1$ ): “Giá các hàng hóa liên quan như trà và bắp được kỳ vọng có tác động dương đến giá xuất khẩu của cà phê và gạo Việt Nam”.

Giả thuyết 3 ( $H_1$ ): “Giá các hàng hóa liên quan như ca cao và lúa mì được kỳ vọng có mối liên hệ đồng biến với giá xuất khẩu của Việt Nam”.

Giả thuyết 4 ( $H_1$ ): “Tỷ giá giảm hay giá đồng tiền Việt Nam mất giá được kỳ vọng có tác động âm đến giá xuất khẩu của Việt Nam”.

Giả thuyết 5 ( $H_1$ ): “Thu nhập được kỳ vọng có ảnh hưởng cùng chiều đến giá xuất khẩu của Việt Nam”.

Giả thuyết 6 ( $H_1$ ): “Giá nguyên nhiên liệu được kỳ vọng có ảnh hưởng cùng chiều đến giá xuất khẩu của Việt Nam”.

Giả thuyết 7 ( $H_1$ ): “Thời điểm thu hoạch của từng mặt hàng được kỳ vọng có ảnh hưởng ngược chiều đến giá xuất khẩu của Việt Nam”.

Như vậy tác động của các yếu tố đến giá xuất khẩu của Việt Nam được thể hiện qua bảng sau:

## CHƯƠNG 3

STT	Tên biến	Tên viết tắt	Ký hiệu	Phân loại biến	Dấu kỳ vọng
1	Giá cà phê/gạo Việt Nam xuất khẩu	LnPVN (DLnPVNCOF)	Y	Biến phụ thuộc Biến định lượng	
2	Tỷ giá hối đoái	LnEX (DLnEX)	X <sub>1</sub>	Độc lập Biến định lượng	+
3	Giá năng lượng	LnPEnergy (DLnPEnergy)	X <sub>2</sub>	Độc lập Biến định lượng	+
4	Giá cà phê/gạo xuất khẩu của Brazil/Thái Lan	LnPBrazil/ThaiLan (DLnPBrazil)	X <sub>3</sub>	Độc lập Biến định lượng	+
5	Giá cà phê xuất khẩu của Colombia/Pakistan	LnPColombia/Pakistan (DlnPColombia)	X <sub>4</sub>	Độc lập Biến định lượng	+
6	Giá trà/bắp của thị trường thế giới	LnPTea/Pcorn (DLnPTea)	X <sub>5</sub>	Độc lập Biến định lượng	-
7	Giá ca cao/lúa mì của thị trường thế giới	LnPCocoa/Pwheat (DLnPCocoa)	X <sub>6</sub>	Độc lập Biến định lượng	+
8	Thu nhập	LnI (DnLnI)	X <sub>7</sub>	Độc lập Biến định lượng	+
9	Quý I (thời điểm trong năm)	Q1	Q1	Biến định tính/ biến giả	
10	Quý II (thời điểm trong năm)	Q2	Q2	Biến định tính/ biến giả	
11	Quý III (thời điểm trong năm)	Q3	Q3	Biến định tính/ biến giả	

### PHƯƠNG PHÁP NGHIÊN CỨU VÀ THIẾT KẾ NGHIÊN CỨU

#### 3.1. Các phương pháp nghiên cứu và các bước thực hiện

##### 3.1.1. Phương pháp nghiên cứu định tính

Luận án áp dụng phân tích tổng hợp và phỏng vấn chuyên gia đại diện cho cơ quan quản lý nhà nước, các nhà nghiên cứu, các doanh nghiệp là những người quản lý có kinh nghiệm trong việc xuất khẩu nông sản ra thị trường thế giới.

##### 3.1.2. Phương pháp thống kê mô tả

##### 3.1.3. Phương pháp phân tích định lượng (Phương pháp thống kê suy diễn)

Luận án thực hiện quy trình phân tích hoàn chỉnh gồm các bước sau đây:

Bước 1: Kiểm định nghiệm đơn vị đối với tính dừng

Bước 2: Kiểm định đồng liên kết, tương quan

Bước 3: Mô hình hiệu chỉnh sai số

$$\Delta Y_t = \beta \Delta X_t - \lambda(Y_{t-1} - Y_0 - Y_0 X_{t-1}) + \varepsilon$$

Trong đó  $\varepsilon$  là phần dư, đặc trưng cho các biến nhiễu, ngẫu nhiên với đặc điểm là trung bình bằng 0, hiệp phương sai bằng 0 và phương sai không đổi. Hệ số  $\varepsilon$  là hệ số đo lường sự thay đổi ngắn hạn lên

Y khi X thay đổi. Hệ số  $\varepsilon$  là hệ số điều chỉnh, quyết định tốc độ phục hồi lại trạng thái cân bằng trong dài hạn.

Bước 4: Kiểm định nhân quả

Bước 5: Mô hình sai phân

### 3.2. Dữ liệu và nguồn dữ liệu

Dữ liệu thứ cấp được thu thập từ nhiều nguồn tài liệu với dữ liệu định lượng theo chuỗi thời gian được thu thập từ UN-Comtrade, IMF, Tổng cục Hải quan, Trang tin Thương mại Bộ NN&PTNT, FAO, ICO.

Dữ liệu sơ cấp được thu thập thông qua phỏng vấn chuyên gia.

## CHƯƠNG 4

### PHÂN TÍCH SỰ BIẾN ĐỘNG GIÁ VÀ XÁC ĐỊNH HỆ SỐ CẠNH TRANH CỦA NÔNG SẢN VIỆT NAM XUẤT KHẨU

#### 4.1. Thực trạng xuất khẩu nông sản (cà phê, gạo) của Việt Nam giai đoạn 1991-2016

##### 4.1.1. Tình hình xuất khẩu cà phê của Việt Nam giai đoạn 1991-2016

Nhìn tổng quát, giai đoạn 2000-2016, sản lượng xuất khẩu cà phê của Việt Nam ra thị trường thế giới có nhiều chuyển biến và có xu hướng ngày càng tăng. Năm 2000, sản lượng cà phê chỉ đạt ở mức 7,339 triệu tấn. Đến năm 2001, con số này giảm mạnh xuống còn 3,285 triệu tấn và duy trì mức độ này trong suốt 5 năm từ 2001 đến 2005. Đến năm 2007, sản lượng cà phê xuất khẩu đột ngột tăng mạnh, đạt tới 9,808 triệu tấn. Từ năm 2008 đến năm 2011, sản lượng xuất khẩu ổn định tương đối và có tăng nhẹ. Đến năm 2012 và năm 2016 thì sản lượng đạt đỉnh điểm cao nhất trên 17 triệu tấn/năm (Un-Comtrade, 2017).

##### 4.1.2. Tình hình xuất khẩu gạo của Việt Nam giai đoạn 1991-2016

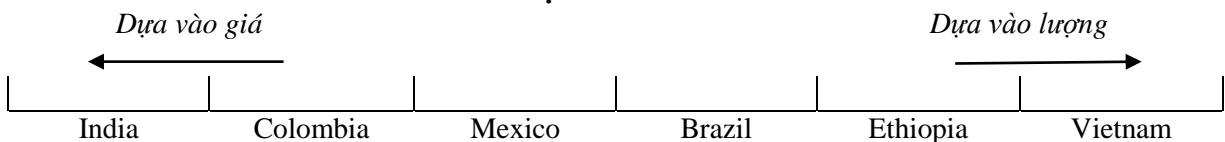
Theo số liệu của Un-Comtrade, nhìn chung, sản lượng gạo xuất khẩu của Việt Nam ra thị trường thế giới ổn định tương đối trong giai đoạn 2001-2004 và có xu hướng tăng dần. Năm 2000, sản lượng gạo đạt ở mức cao 3,478 triệu tấn. Tuy nhiên, đến năm 2001 thì con số này đã giảm đáng kể xuống còn 1,805 triệu tấn và duy trì mức độ này trong suốt 4 năm từ 2001 đến năm 2004. Đến năm 2005, sản lượng gạo xuất khẩu tăng trở lại và đạt mức 1,914 triệu tấn. Con số này tiếp tục tăng dần và đạt đỉnh điểm vào năm 2011 lên đến 7,116 triệu tấn. Từ năm 2011 đến năm 2015, giá trị sản lượng tăng giảm không đáng kể. Đến thời điểm hiện tại sản lượng giảm mạnh còn 4,8 triệu tấn/năm.

#### 4.2. Kết quả phân tích cho mặt hàng cà phê xuất khẩu

##### 4.2.1. Hiệu ứng giá và lượng (Quality effect và Quantity effect)

Từ kết quả tính toán hiệu ứng giá và lượng, nghiên cứu phân biệt 3 nhóm quốc gia cho mặt hàng cà phê:

**Hình 4.1. Định vị “xuất khẩu bền vững” các quốc gia qua hiệu ứng giá và lượng trung bình giai đoạn 2000- 2014**



Các quốc gia thuộc nhóm dựa vào giá: Mexico, Colombia, India, Brazil

Các quốc gia thuộc nhóm dựa vào lượng: Vietnam

Các quốc gia thuộc nhóm trung hòa: Ethiopia

##### 4.2.2. Sự biến động giá và một số nguyên nhân làm giá cà phê thế giới và Việt Nam bất ổn

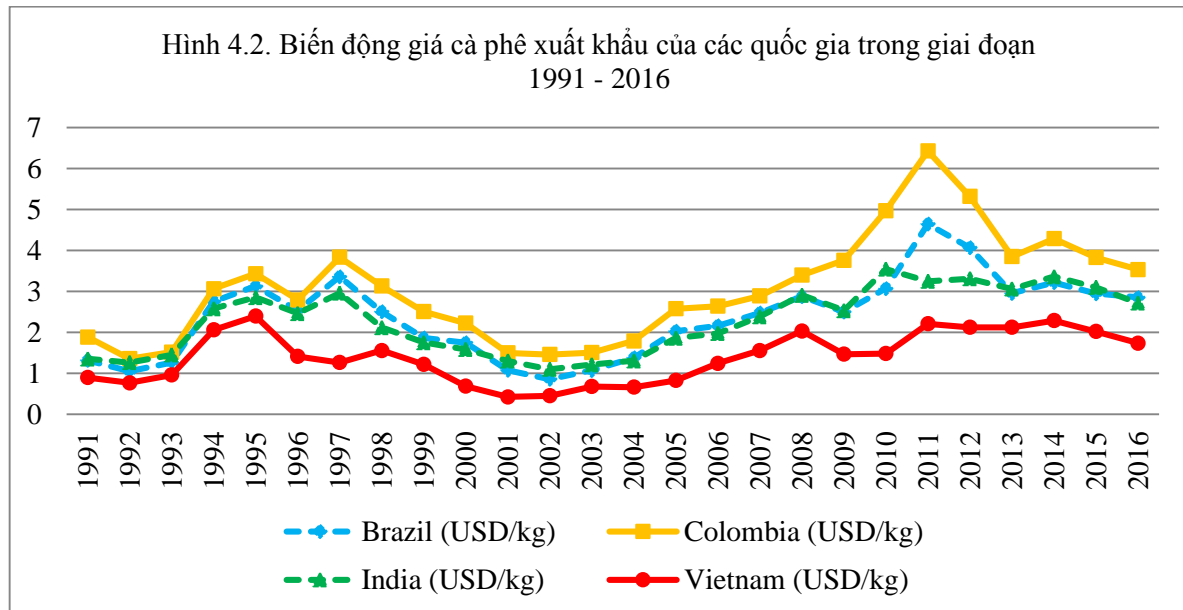
###### Diễn biến giá cà phê thế giới

Giá cà phê thế giới bị ảnh hưởng bởi quy luật cung cầu của thị trường. Ngoài ra, giá cà phê thế giới tăng giảm theo một quy luật có tính chu kỳ. Cứ sau bảy năm, giá cà phê thế giới lại trải qua một đợt rớt giá mạnh (World Bank, 2004). Trong suốt thời gian nghiên cứu từ năm 1991 đến năm 2016, giá cà phê Việt Nam, Brazil, Colombia và Ấn Độ trên thị trường quốc tế luôn bám sát giá cà phê thế giới ở hầu



hết các khoảng thời gian. Do đó, giá cà phê xuất khẩu của cả bốn nước này có cùng xu hướng với nhau ở hầu hết thời gian nghiên cứu.

Giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam đi ngược với xu hướng của giá cà phê thế giới và ba nước còn lại ở giai đoạn từ 1997 đến 2004. Trong khi đó, giá cà phê xuất khẩu của Colombia có xu hướng cao hơn và phản ứng chậm hơn đối với những biến động trên thị trường cà phê thế giới so với ba nước còn lại. Ngoài ra, giá cà phê xuất khẩu của Colombia có khuynh hướng biến động nhiều hơn so với Việt Nam, Brazil và Ấn Độ, với những lần tăng và giảm giá rất mạnh. Ngược lại, Việt Nam là nước có giá cà phê xuất khẩu thấp nhất. Mức giá của Việt Nam thường thấp hơn giá cà phê trên thị trường thế giới. Cụ thể, trong giai đoạn 2000 – 2006, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam thấp hơn giá chi thị của Tổ chức Cà phê Quốc tế (ICO) khoảng 25% (Đoàn Triệu Nhật, 2009).



(Nguồn: Tác giả tổng hợp từ UN-Comtrade và Tổng cục Hải quan)

### Các yếu tố chính tác động đến giá cà phê xuất khẩu

#### Bổ sung

Giá cà phê Việt Nam xuất khẩu bị tác động bởi các yếu tố: tài chính và thị trường toàn cầu, nguồn cung thế giới, thời tiết, nhu cầu cà phê trên thế giới, lượng dự trữ cà phê. Tác động của yếu tố thời tiết đến giá cà phê Việt Nam được thấy rõ qua giai đoạn 2004-2005 và năm 2009. Nguồn cung eo hẹp chính là nguyên nhân chủ yếu làm giá cà phê Việt Nam tăng năm 2011.

### 4.2.3 Kết quả từ mô hình phân tích giá cà phê

Kết quả kiểm định thống kê tính dừng của các biến được quan sát

Bảng 4.1. Kết quả kiểm định thống kê tính dừng của các biến được quan sát

Tên biến	P value	Giá trị tới hạn 5%	Sai phân
LnPVN	0.78	-1.56	Bậc 1
LnEX	0.839	-1.447625	Bậc 0
LnPcocoa	0.58	-2.017204	Bậc 1
LnPtea	0.68	-1.826889	Bậc 1
LnPColombia	0.26	-2.639025	Bậc 1
LnBrazil	0.6911	-1.808842	Bậc 1
LNPENERGY	0.9655	-0.746944	Bậc 1

Các giá trị p value cho thấy không thể bác bỏ giả thuyết  $H_0$  ở mức độ tin cậy 95% hay các biến không có tính dừng. Điều này cho biết mô hình phân tích dạng logarit kép không bị hiện tượng hồi qui giả mạo hay chúng ta có thể sử dụng kết quả hồi qui này để phân tích.

Kiểm định nhân quả giữa các biến

Dựa vào giá trị p có thể kết luận Colombia và Brazil thực sự có ảnh hưởng rất lớn đến giá xuất khẩu của Việt Nam ở mức độ tin cậy 99% (giá trị p lần lượt 0.0068; 0.0025). Tuy nhiên khi xét theo chiều tác động ngược lại, Việt Nam không ảnh hưởng đến Brazil, đối với Colombia thì giá cà phê Việt Nam có tác động đến giá xuất khẩu của nước này tuy nhiên chỉ ở mức độ tin cậy 90% (phụ lục 2).

*Kết quả phân tích mô hình logarit kép*

Sau khi thực hiện kiểm định và khắc phục các sai phạm: tự tương quan, thiếu và thừa biến, phương sai của sai số thay đổi, kết quả hồi qui của mặt hàng cà phê như sau:

$$\text{LnYt1} = -0.831253*** + 0.313186***\text{LnX1t1} + 0.500857***\text{LnX1t2} - 0.350580***\text{LnX1t3} - 0.038631\text{LnX1t4} + 0.035433\text{LnX1t5} + 0.026533***\text{Q1} + 0.030656***\text{Q2} + 0.020975***\text{Q3} + e_t$$

$$n=79; R^2=0.7414; \bar{R}^2 = 0.7118; D.W=1,67$$

**Nhận xét:**

Xem xét trong dài hạn, các yếu tố có tác động (xét về ý nghĩa thống kê) mạnh đến giá cà phê Việt Nam xuất khẩu đó là tỷ giá hối đoái, giá cà phê xuất khẩu từ các nước dẫn đầu thế giới như Colombia và Brazil. Ngoài ra, thời điểm xuất khẩu trong năm (các quý trong một năm xuất khẩu) cũng tác động đến giá cà phê xuất khẩu.

Trong giai đoạn phân tích, tính trung bình thì đồng tiền của hai nước này mạnh lên còn đồng tiền Việt Nam liên tục mất giá. Theo ý kiến của các chuyên gia được phỏng vấn thì 92% cho rằng tỷ giá có ảnh hưởng đến số lượng hàng hóa xuất khẩu và có tác động đến giá xuất khẩu xét trong dài hạn. Nếu xét trong ngắn hạn thì tùy thời điểm xuất khẩu mà những thay đổi tỷ giá có thể tác động mạnh hay yếu lên giá xuất khẩu. Bên cạnh đó, cũng theo kết quả phỏng vấn các chuyên gia thì tỷ giá lại có tác động lên giá xuất khẩu theo mỗi tương quan cùng chiều. Nếu đồng tiền Việt Nam lên giá (hay giá trị tỷ giá giảm) thì các nước (khách hàng) nhập khẩu mặt hàng cà phê sẽ thỏa thuận với các doanh nghiệp Việt Nam thông qua Hiệp hội cà phê để giảm giá xuất khẩu. Ngoài ra, theo kết quả từ mô hình 2, nếu tỷ giá thay đổi 1% thì giá cà phê Việt Nam thay đổi 0.313% (giả định các yếu tố không thay đổi).

Tác động của giá từ một số nước cạnh tranh mạnh với hàng hóa xuất khẩu từ Việt Nam trên thị trường thế giới, khi giá cà phê của Brazil tăng cũng làm cho giá cà phê Việt Nam xuất khẩu tăng ( $\hat{\beta}_2 \geq 0$ ) trong khi đó tác động này lại ngược chiều đối với hàng hóa từ Colombia ( $\hat{\beta}_3 \leq 0$ ). Nếu giá cà phê xuất khẩu từ Brazil thay đổi 1% thì giá cà phê Việt Nam thay đổi 0.5%, trong khi đó giá từ Colombia chỉ làm cho Việt Nam thay đổi 0.35% (các yếu tố khác giữ nguyên không đổi). Những kết quả phân tích này cũng tương đồng với ý kiến của các chuyên gia, cho rằng cà phê Việt Nam thực sự bị cạnh tranh mạnh về giá từ các nước Brazil, Ấn Độ, họ lại không lo ngại nhiều về giá xuất khẩu của Colombia. Theo Maurice và David (2011), trong dài hạn giá của cà phê và ca cao có xu hướng biến động giống như nhau ở thị trường các nước đang phát triển phụ thuộc vào hàng hóa CDDCs (Commodity dependent developing countries). Hơn thế nữa giữa giá cà phê và ca cao cũng có mối quan hệ nhân quả. Tuy nhiên trong nghiên cứu hiện tại, trường hợp cà phê xuất khẩu của Việt Nam, tác động của giá ca cao đến giá cà phê Việt Nam không đủ mạnh (không có ý nghĩa thống kê) xét trong dài hạn. Tương tự cho yếu tố về giá dầu, giá dầu có ảnh hưởng nhân quả đến giá cà phê ở các nước CDDCs (Maurice và David, 2011).

Theo kết quả của Baffes (2008), căn cứ trên chỉ số giá, thì giá dầu thế giới có ảnh hưởng đến giá của các hàng hóa chính được thương mại trên thị trường thế giới, đồng thời giá hàng hóa thương mại đặc biệt là mặt hàng thực phẩm tăng cao và duy trì trong thời gian dài nếu giá dầu tăng và những tác động này được ghi nhận trong giai đoạn từ rất lâu từ năm 1960-2005. Điều này lại không đúng với kết quả của nghiên cứu hiện tại, những số liệu thống kê cho thấy giá dầu thế giới không tác động đủ mạnh đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam xét cả trong ngắn và dài hạn

*Kết quả phân tích mô hình hiệu chỉnh sai số ECM*

Mô hình tổng quát:

$$\Delta \ln p_{it} = \alpha_i + \sum_{k=1}^{r-1} C_{ik} \Delta \ln p_{it-k} + \sum_j \sum_{l=0}^{s-1} E_{ijl} \ln q_{jt-l} + \sum_{l=0}^{s-1} E_{il} \ln X_{t-l} - \omega (\ln p_{t-r} - \sum_j \eta_{ij} \ln q_{jt-s} - \eta_i \ln X_{t-s})$$

$$\begin{aligned} \text{LnP}_{\text{VNt}} &= 0.303 - 0.424 \Delta \text{Lag}_{(t-1)} \text{LnP}_{\text{VNt}}*** - 0.248 \Delta \text{Lag}_{(t-2)} \text{LnP}_{\text{VNt}}*** + 0.183 \Delta \text{Lag}_{(t-1)} \text{LnP}_{\text{Brazilt}}*** + 0.1 \Delta \text{Lag}_{(t-2)} \text{LnP}_{\text{Brazilt}} + 0.157 \Delta \text{Lag}_{(t-1)} \text{LnP}_{\text{Colombiat}}*** + 0.098 \Delta \text{Lag}_{(t-1)} \text{LnP}_{\text{Colombiat}}*** \end{aligned}$$

$$2) \ln P_{\text{Colombiat}} + 0.266 \ln P_{\text{Brazil}}^{***} - 0.195 \ln P_{\text{Colombiat}} - 0.056 \ln P_{\text{Teat}} + 0.019 \ln P_{\text{Energyt}} - 0.525 \ln P_{\text{Ext}}^{***} - 0.0065 Q_{1t} - 0.0092 Q_{2t} - 0.0344 Q_{3t}^{***} + e_t$$

$n=79; R^2=0.6951$

Giá cà phê Brazil và Colombia đều có ảnh hưởng đến giá cà phê Việt Nam trong ngắn hạn, xét dài hạn, giá cà phê từ Brazil thực sự ảnh hưởng đến giá Việt Nam, trong khi đó thì cà phê từ Colombia lại không ảnh hưởng Việt Nam, phân khúc thị trường của cà phê và Việt Nam và Colombia khác nhau cũng như cách tiếp cận khách hàng của Colombia cũng khác biệt khi quốc gia này có nguồn vốn mạnh có thể thực hiện chiến lược marketing tốt hơn so với Việt Nam. Như vậy đối với mặt hàng cà phê, có sự ảnh hưởng rất lớn về giá giữa các quốc gia, một hoặc một vài quốc gia có biến động về giá thì lập tức giá của các nước khác sẽ bị thay đổi theo (trong ngắn và dài hạn). Yếu tố về nhiên liệu và giá các hàng hóa liên quan như ca cao không có ảnh hưởng đến cà phê Việt Nam (xét trong ngắn hạn).

#### 4.3. Kết quả phân tích biến động giá gạo

##### 4.3.1. Hiệu ứng giá và lượng (Price effect và Quantity effect)

Từ kết quả tính toán hiệu ứng giá và lượng (bảng 1), các quốc gia xuất khẩu chính được phân thành 3 nhóm:

Hình 4.5. Định vị “xuất khẩu bền vững” các quốc gia qua hiệu ứng giá và lượng trung bình giai đoạn 2000- 2014



Các quốc gia thuộc nhóm dựa vào chất lượng để đẩy mạnh giá: USA, Spain, Thailand, Brazil, Parkistan, Netherland

Các quốc gia thuộc nhóm dựa vào lượng: China, Vietnam, India, Uruguay

Các quốc gia thuộc nhóm trung hòa: Argentina và Australia

##### 4.3.2. Sự biến động giá và một số nguyên nhân làm giá gạo thế giới và Việt Nam bất ổn

###### Diễn biến giá gạo thế giới

Giá gạo xuất khẩu của Việt Nam trải qua những dao động đáng kể và có xu hướng ngày càng tăng lên. Dù nằm trong top đầu xuất khẩu gạo, song giá gạo của Việt Nam luôn phụ thuộc vào sự biến động thất thường của giá gạo trên thị trường thế giới. Do gạo là một mặt hàng nông sản chiến lược nuôi sống hơn một nửa dân số thế giới, nên chỉ cần cung và cầu chênh lệch nhau một vài triệu tấn do được mùa hay mất mùa ở các quốc gia sản xuất và tiêu dùng lớn, hay ở các quốc gia xuất khẩu gạo chủ yếu, thì cũng đủ tạo ra các cơn sốt trên thị trường gạo thế giới

###### Các yếu tố chính tác động đến giá gạo xuất khẩu

Các yếu tố chính làm thay đổi giá gạo xuất khẩu của Việt Nam như hạn ngạch, các hiệp định thương mại, thời tiết, nhu cầu từ các nước. Cụ thể trong giai đoạn 2014-2016, một số nước nhập khẩu truyền thống như Philippines, Indonesia và Malaysia tăng cường nhập khẩu để làm đầy kho dự trữ đã tác động đến sự tăng giá gạo của Việt Nam. Theo kết quả đàm phán được nhất trí sau vòng Uruguay 1994, Nhật Bản và Hàn Quốc đã đồng ý mở cửa thị trường gạo của họ để nhập khẩu gạo với cơ chế hạn ngạch thuế ngạch tạo ra cơ hội tiếp cận thị trường tối thiểu (FAO, 2004). Nhờ đó, lượng và giá xuất khẩu của các nước tăng dần trong đó có Việt Nam.

###### 4.3.3. Phân tích tác động của các yếu tố thông qua mô hình hồi qui

Kết quả kiểm định thống kê tính dừng cho thấy không thể bác bỏ tất cả giả thuyết  $H_0$  ở mức độ tin cậy 95%, như vậy chỉ có giá gạo Việt Nam và Pakistan có tính ổn định và cân bằng trong dài hạn.

Kiểm định nhân quả giữa các biến dựa vào giá trị p có thể kết luận Thái Lan thực sự có ảnh hưởng rất lớn đến giá xuất khẩu của Việt Nam ở mức độ tin cậy 99%, Pakistan cũng có ảnh hưởng đến Việt Nam nhưng tác động này rất nhỏ về mặt thống kê (p-value 0.0837). Trong khi xét theo chiều tác động ngược lại, Việt Nam mặc dù là một trong những quốc gia xuất khẩu đứng đầu thế giới nhưng giá gạo của Việt Nam lại không ảnh hưởng đến hai nước xuất khẩu khác là Thái Lan và Pakistan.

*Kết quả phân tích mô hình logarit kép*

Mô hình hồi qui sau khi khắc phục sai phạm (Mô hình 4) như sau:

$$\text{Ln}Y_{1t} = 1.143045^{***} - 0.566946^{**}\text{Ln}X_{1t} + 0.151433\text{Ln}X_{1t2} + 0.220073^{***}\text{Ln}X_{1t3} + 0.112693\text{Ln}X_{1t4} - 0.111877\text{Ln}X_{1t5} - 0.043993^{***}Q_1 - 0.059961^{***}Q_2 + -0.053630^{***}Q_3 + e_t$$

$$n=79; R^2=0.319467; \bar{R}^2 = 0.24169; D.W=1,368$$

Trong đó:

- X<sub>1</sub>: Biến tỷ giá;
- X<sub>2</sub>: Giá bắp;
- X<sub>3</sub>: Giá dầu;
- X<sub>4</sub>: Giá gạo xuất khẩu từ Pakistan;
- X<sub>5</sub>: Giá gạo xuất khẩu từ Thái Lan.

#### Nhận xét

Xem xét trong dài hạn, các yếu tố có tác động (xét về ý nghĩa thống kê) mạnh đến giá gạo Việt Nam xuất khẩu đó là tỷ giá hối đoái, giá gạo xuất khẩu từ các nước dẫn đầu thế giới như Thái Lan và Pakistan.

Tác động của tỷ giá hối đoái lên mặt hàng xuất khẩu gạo khác với cà phê. Vì gạo là một mặt hàng xuất khẩu lâu đời từ trước chiến tranh, trước năm 1961, do đó những ảnh hưởng của sức mạnh đồng tiền thể hiện rõ lên giá xuất khẩu và đúng như lý thuyết, khi giá trị của biến tỷ giá tăng (đồng nội tệ mất giá) thì giá xuất khẩu tính theo ngoại tệ sẽ giảm (giá xuất khẩu tính theo ngoại tệ là tỷ số giữa giá nội tệ và tỷ giá). Theo ý kiến chuyên gia, có một số nguyên nhân dẫn đến kết quả tỷ giá tăng nhưng không mang lại hiệu quả xuất khẩu đó là (1) cầu về gạo của Việt Nam không có tăng đột biến mà tương đối ổn định; (2) nguyên liệu sản xuất của Việt Nam phần lớn nhập khẩu, khi tỷ giá giảm lập tức tác động đến nhập khẩu dẫn đến giá thành cao do đó những tác động của tỷ giá đến xuất chỉ thấy rõ trong dài hạn. Đối với mặt hàng gạo, trong giai đoạn phân tích, mặc dù đồng Baht của Thái Lan mạnh lên so với đồng Đô la Mỹ (vào năm 2000, 1 USD bằng với 40.195 Baht, đến năm 2014, 1USD bằng 32.544 rupee) nhưng giá trị của đồng tiền các nước khác cạnh tranh khác với Việt Nam cũng giảm, đặc biệt là các nước mới gia nhập thị trường, hay là các đối thủ mới của Việt Nam, như giá trị đồng rupee của Pakistan giảm liên tục từ năm 2005 cho đến nay (phụ lục 3.2) hay đồng tiền rupee của Ấn độ cũng bị phá giá nhằm hỗ trợ cho việc xuất khẩu. Từ giá trị của hệ số hồi qui cho thấy tác động của tỷ giá hối đoái đến giá cà phê xuất khẩu đúng với kỳ vọng ( $\beta_1 > 0$ ), khi đồng nội tệ của Việt Nam bị mất giá (tỷ giá tăng) trong khi đó đồng tiền của đối thủ mạnh lên thì giá xuất khẩu của Việt Nam sẽ tăng điều này cũng phù hợp với những phát biểu của Jennifer J. Kristinek và David P. Anderson (2002). Ngoài ra, yếu tố mùa vụ (các quý trong một năm xuất khẩu) cũng tác động đến giá gạo xuất khẩu.

#### 4.3.4. Kết quả phân tích mô hình ECM

Mô hình ECM:

$$D\text{Ln}Y_t = \gamma_0 + \gamma_1 D\text{Ln}X_{1t} + \gamma_2 D\text{Ln}X_{2t} + \gamma_3 D\text{Ln}X_{3t} + \gamma_4 D\text{Ln}X_{4t} + \gamma_5 D\text{Ln}X_{5t} + \delta \varepsilon_{t-1} \quad (\text{Mô hình 3.1})$$

Mô hình được triển khai như sau:

$$\text{Ln}Y_t = \gamma_0 + \text{Ln}Y_{t-1} + \gamma_1 \text{Ln}X_{1t} - \gamma_1 \text{Ln}X_{1t-1} + \gamma_2 \text{Ln}X_{2t} - \gamma_2 \text{Ln}X_{2t-1} + \gamma_3 \text{Ln}X_{3t} - \gamma_3 \text{Ln}X_{3t-1} + \gamma_4 \text{Ln}X_{4t} - \gamma_4 \text{Ln}X_{4t-1} + \gamma_5 \text{Ln}X_{5t} - \gamma_5 \text{Ln}X_{5t-1} + \delta (\text{Ln}Y_{t-1}) - \delta \beta_0 - \delta \beta_1 \text{Ln}X_{1t-1} - \delta \beta_2 \text{Ln}X_{2t-1} - \delta \beta_3 \text{Ln}X_{3t-1} - \delta \beta_4 \text{Ln}X_{4t-1} - \delta \beta_5 \text{Ln}X_{5t-1}$$

Mô hình được tổng hợp như sau:

$$\text{Ln}Y_t = \alpha_0 + \alpha_1 \text{Ln}X_{1t} + \alpha_2 \text{Ln}X_{2t} + \alpha_3 \text{Ln}X_{3t} + \alpha_4 \text{Ln}X_{4t} + \alpha_5 \text{Ln}X_{5t} + \alpha_6 \text{Ln}Y_{t-1} + \alpha_7 \text{Ln}X_{1t-1} + \alpha_8 \text{Ln}X_{2t-1} + \alpha_9 \text{Ln}X_{3t-1} + \alpha_{10} \text{Ln}X_{4t-1} + \alpha_{11} \text{Ln}X_{5t-1} + \alpha_{12} Q_1 + \alpha_{13} Q_2 + \alpha_{14} Q_3 + \alpha_{15} Q_{1t-1} + \alpha_{16} Q_{1t-1} + \alpha_{17} Q_{1t-1}$$

Kết quả phân tích tác động của các yếu tố đến giá gạo xuất khẩu trong dài hạn:

$$\text{Ln}Y_t = 0.72 + 0.317 \text{Ln}X_{1t} - 0.067 \text{Ln}X_{2t} + 0.0524 \text{Ln}X_{3t} + 0.09 \text{Ln}X_{4t} - 0.069 \text{Ln}X_{5t} + 0.383 \text{Ln}Y_{t-1} - 0.667 \text{Ln}X_{1t-1} - 0.002 \text{Ln}X_{2t-1} + 0.017 \text{Ln}X_{3t-1} + 0.0032 \text{Ln}X_{4t-1} + 0.2 \text{Ln}X_{5t-1} - 0.038 Q_{1t} + 0.01 Q_{1t-1} - 0.024 Q_{2t} - 0.003 Q_{2t-1} - 0.0054 Q_{3t} - 0.028 Q_{3t-1} + e_t$$

#### Nhận xét

Đối với mặt hàng gạo, từ kết quả mô hình ECM và theo ý kiến của các chuyên gia, các yếu tố bao gồm tỷ giá, giá của các nước cạnh tranh trên thị trường thế giới chỉ tác động đến giá xuất khẩu Việt Nam trong dài hạn hay nói cách khác trong ngắn hạn, tức thời, các yếu tố này không ảnh hưởng đến giá gạo xuất khẩu của Việt Nam và sau đó có sự điều chỉnh trong dài hạn. Tuy nhiên khi căn cứ vào độ lớn

của các hệ số hồi qui thì Pakistan có ảnh hưởng đến Việt Nam nhiều hơn so với Thái Lan. Xét yếu tố về thời gian thì giai đoạn 3 tháng đầu của mỗi năm, giá xuất khẩu thấp hơn so với 3 tháng cuối của năm.

#### 4.4. Kết quả nghiên cứu về lợi thế so sánh và hệ số cạnh tranh của các nước so với Việt Nam

##### 4.4.1. Lợi thế so sánh

Từ số liệu lấy từ UN-Comtrade trong giai đoạn 2010-2014, chỉ số RCA của các quốc gia xuất khẩu chính hai mặt hàng nông sản chủ lực gạo và cà phê cao. Đối với mặt hàng gạo, khi so sánh Việt Nam với 4 nước xuất khẩu chủ lực khác như Pakistan, Ấn Độ, Thái Lan, USA nhìn chung Việt Nam có lợi thế chỉ cao hơn một quốc gia đó là USA điều này cũng tương tự đối với mặt hàng cà phê, lợi thế của Việt Nam chỉ cao hơn so với India. Tính trong năm 2010, chỉ số RCA của Pakistan cao nhất (RCA = 78.216), gấp 2.36 lần so với vị trí đứng thứ hai của Việt Nam (RCA=33.086) và vị trí đứng thứ ba là Thái Lan (RCA = 20.114). Lợi thế so sánh của nước ta trong cơ sở dữ liệu của UN Comtrade lại cao hơn Thái Lan, nhưng thực tế, năng lực cạnh tranh của nước ta lại không bằng Thái Lan. Năm 2014, RCA của các quốc gia đa phần đều giảm, riêng India lại tăng (RCA = 17.745). Tuy giảm nhưng RCA của Pakistan vẫn dẫn đầu (RCA = 63.416) gấp 3.574 lần so với India, nước có chỉ số RCA = 17.745 giữ vị trí thứ hai, vị trí thứ ba thuộc về Thái Lan (RCA = 17.034) và thứ tư là của Việt Nam (RCA = 13.935). Như vậy, trong giai đoạn 2014 – 2015, chỉ số RCA giữa các quốc gia có sự thay đổi rõ rệt và vị trí thay thế cho nhau, cho thấy, mỗi quốc gia đang nâng tầm lợi thế sản phẩm xuất khẩu trên thị trường thế giới. Trong các quốc gia được so sánh, RCA của Mỹ rất thấp so với các quốc gia còn lại, mặc dù năm 2010, RCA của Mỹ >1 (RCA = 1.342) có lợi thế so sánh, đến năm 2014 RCA giảm xuống chỉ còn 0.877 < 1 mất lợi thế so sánh với các quốc gia còn lại. Đối với mặt hàng cà phê, Uganda là quốc gia trong giai đoạn 2010 – 2014 có chỉ số RCA luôn dẫn đầu, và chỉ số RCA năm 2014 (RCA = 121.329) gấp 1.88 lần so với năm 2010 (RCA = 64.5). Ngược lại, các chỉ số RCA của các quốc gia được so sánh còn lại giảm trong giai đoạn này. Trong khoảng thời gian này Colombia giữ vị trí thứ hai, Brazil thứ ba và Việt Nam giữ vị trí thứ 4. India có chỉ số RCA >1, nhưng lại có khoảng chênh lệch rất lớn so với các quốc gia còn lại.

##### 4.4.2. Hệ số cạnh tranh

###### 4.4.2.1. Đối với mặt hàng gạo

Hệ số cạnh tranh về giá giữa Việt Nam và Pakistan là:  $\varepsilon_2 = \alpha_4 = 0.09$

Nếu giá gạo Pakistan thay đổi 1% thì giá gạo Việt Nam phản ứng đến 0.09% trong đó phản ứng của Việt Nam nhẹ hơn khi Thái Lan thay đổi giá (giá trị thay đổi là 0.069%, giá định các yếu tố khác giữ nguyên không đổi). Dấu dương ở hệ số cạnh tranh cho biết gạo của Pakistan và Việt Nam là hai mặt

hàng cạnh tranh nhau. Hệ số cạnh tranh về giá giữa Việt Nam và Thái Lan:  $\varepsilon_2 = \alpha_5 = -0.069$ . Từ hệ số trên cũng cho biết gạo xuất khẩu từ Thái Lan và Việt Nam là hai mặt hàng không cạnh tranh nhau (bổ sung cho nhau). So sánh về độ lớn của hệ số hồi qui cũng cho thấy tác động của giá Pakistan đến Việt Nam mạnh hơn so với Thái Lan. Theo ý kiến các chuyên gia, các nước cạnh tranh rất lớn với gạo Việt Nam trên thị trường thế giới là Thái Lan, Ấn Độ, Pakistan, Trung Quốc, Campuchia và Myanmar.

###### 4.4.2.2. Đối với mặt hàng cà phê

Kết quả từ mô hình ECM cho biết hệ số cạnh tranh về giá giữa Việt Nam và Brazil:

$\varepsilon_1 = \hat{\beta}_2 = 0.266$ . Điều này cho biết cà phê của Brazil và Việt Nam là hai mặt hàng cạnh tranh nhau. Hệ số cạnh tranh về giá giữa Việt Nam và Colombia:  $\varepsilon_2 = \hat{\beta}_3 = -0.195$ . Từ hệ số trên cũng cho biết cà phê Colombia và Việt Nam là hai mặt hàng không cạnh tranh nhau (bổ sung cho nhau). So sánh về độ lớn của hệ số hồi qui cũng cho thấy tác động của giá Brazil đến Việt Nam mạnh hơn so với Colombia. Theo ý kiến các chuyên gia, các nước cạnh tranh rất lớn với cà phê Việt Nam trên thị trường thế giới là Brazil, Colombia và Indonesia. Nếu so với nước có loại cà phê tương đồng với Việt Nam là Brazil và Indonesia thì cà phê Việt Nam đã khó cạnh tranh về giá hai nước này. Như vậy khi đánh giá về các đối thủ cạnh tranh xuất khẩu thì rõ ràng Việt Nam cần có quan tâm đến đối thủ rất mạnh với mình đó là Brazil.

## CHƯƠNG 5

### GIẢI PHÁP PHÒNG NGỪA RỦI RO BIẾN ĐỘNG GIÁ VÀ NÂNG CAO

## **NĂNG LỰC CẠNH TRANH NÔNG SẢN VIỆT NAM TRÊN THỊ TRƯỜNG THẾ GIỚI**

### **5.1. Dự báo phát triển nông sản xuất khẩu, khả năng cạnh tranh của nông sản trên thị trường thế giới**

Các tổ chức nước ngoài cung cấp nhiều dự báo về tình hình sản xuất nông sản và thị trường nông sản như dự báo của Hiệp hội cà phê thế giới, FAO và USDA. Cục Xúc tiến thương mại trong nước cung cấp thông tin về diện tích sản xuất trong nước và của các nước xuất khẩu chủ lực trên thế giới. Đây là một trong những cơ sở nhằm đề xuất giải pháp phù hợp cho Việt Nam.

### **5.2. Quan điểm, mục tiêu và định hướng phát triển nông sản xuất khẩu và nâng cao năng lực cạnh tranh của nông sản Việt Nam trên thị trường thế giới**

#### **5.2.1 Quan điểm và mục tiêu phát triển nông sản xuất khẩu**

Quan điểm về xuất khẩu của Việt Nam thể hiện trong quyết định của Chính phủ, Nghị quyết của Đảng, đồng thời mục tiêu phát triển tổng thể của quốc gia là tiền đề để hoạch định những chính sách xuất khẩu cho Việt Nam.

#### **5.2.2. Định hướng phát triển nông sản xuất khẩu và nâng cao năng lực cạnh tranh của nông sản xuất khẩu trên thị trường thế giới**

Căn cứ vào Chiến lược xuất nhập khẩu hàng hóa trong giai đoạn 10 năm, 20 năm của Thủ tướng Chính phủ; Đề án phát triển thương mại nông thôn Việt Nam và một số công trình nghiên cứu liên quan đến định hướng phát triển nông sản xuất khẩu Việt Nam của một tác giả được tham khảo để luận án đề xuất giải pháp.

### **5.3. Các giải pháp phòng ngừa rủi ro biến động giá của nông sản xuất khẩu Việt Nam trên thị trường thế giới**

*5.3.1. Nâng cao năng lực dự báo giá*

*5.3.2. Ứng dụng công nghệ thông tin*

### **5.4. Nâng cao năng lực cạnh tranh của nông sản Việt Nam**

*5.4.1. Nhóm giải pháp về nhân lực*

*5.4.2. Nhóm giải pháp về chất lượng sản phẩm*

*5.4.3. Nhóm giải pháp giảm giá thành sản xuất*

*5.4.4. Nhóm giải pháp về vốn sản xuất và tín dụng*

*5.4.5. Nhóm giải pháp liên quan đến vấn đề thương hiệu*

*5.4.6. Nhóm giải pháp liên quan đến thị trường tiêu thụ và các thị trường xuất khẩu*

### **KẾT LUẬN**

Kết quả phân tích định tính cho thấy, nhìn chung các yếu tố chính tác động đến giá nông sản bao gồm thời tiết, yếu tố tài chính, nhu cầu, lượng dự trữ trên thế giới. Đối với mặt hàng cà phê, độ co giãn của cung theo giá thấp trong ngắn hạn và cao hơn trong dài hạn. Giai đoạn 2012-2013, giá cà phê tăng cao do ảnh hưởng từ cuộc khủng hoảng tài chính thế giới, dự trữ cà phê ở mức thấp và vụ mùa ở vùng Trung Mỹ đến muộn. Đối với mặt hàng gạo, giá gạo Việt Nam ở giai đoạn 1985-1987 ở mức thấp là do nhu cầu nhập khẩu gạo của các nước Châu Á giảm nhờ ảnh hưởng tích cực từ cuộc Cách mạng xanh trong nông nghiệp và thời tiết thuận lợi.

Với mô hình Bertrand, dưới góc độ kinh tế vi mô, các yếu tố tác động đến giá nông sản nói chung bao gồm giá hàng hóa liên quan và yếu tố mùa vụ. Xét dưới góc độ thương mại, tỷ giá và giá của các nước cạnh tranh có ý nghĩa đáng kể đối với hoạt động xuất khẩu của Việt Nam. Theo kiểm định nhân quả thì giá cà phê Brazil và Colombia làm cho giá Việt Nam biến động nhưng ngược lại giá cà phê Việt Nam không có ảnh hưởng đáng kể đến hai nước này. Xét trong dài hạn, tỷ giá và giá từ các nước cũng như yếu tố mùa vụ có ảnh hưởng đến giá cà phê Việt Nam tuy nhiên trong ngắn hạn thì giá chỉ phụ thuộc vào thời điểm xuất khẩu. Kết quả này cũng tương tự như kết quả của mô hình phân tích giá gạo. Khi phân tích hệ số cạnh tranh, kết quả cho thấy, cà phê của Colombia và Việt Nam không cạnh tranh với nhau, kết quả này cũng lặp lại cho trường hợp gạo của Việt Nam và Thái Lan.

Thông qua hiệu ứng giá-lượng và chỉ số RCA, có thể đưa ra nhận định cơ bản về xuất khẩu bền vững của Việt Nam. Kết quả cho thấy, hoạt động xuất khẩu cà phê của Việt Nam có biểu hiện tốt hơn so

với xuất khẩu gạo do xuất khẩu cà phê dựa vào hiệu ứng giá và năng lực cạnh tranh của Việt Nam trong những năm gần đây được cải thiện.

Từ kết quả trên, luận án đề xuất một số giải pháp liên quan đến cơ quan quản lý nhà nước như nâng cao năng lực dự báo giá, hỗ trợ tín dụng, hoàn thiện chính sách thuế khi người sản xuất áp dụng tiến bộ kỹ thuật trong sản xuất, thông tin thị trường và quảng bá thương hiệu sản phẩm. Song hành với Chính phủ là những giải pháp của người sản xuất và doanh nghiệp bao gồm việc ứng dụng công nghệ thông tin trong sản xuất và quản lý, tuân thủ quy trình sản xuất nhằm đảm bảo chất lượng, kêu gọi mọi người cần liên kết từ khâu sản xuất, kinh doanh và cả việc tuân thủ qui định của nhà nước.

## DANH MỤC CÁC CÔNG TRÌNH NGHIÊN CỨU

### Tạp chí quốc tế

1. Effects of Exchange Rate and World Prices on Export Price of Vietnamese Coffee. International Journal of Economics and Financial Issues, ISSN: 2146-4138, 2016, 6(4), 1756-1759, Scopus
2. To Thi Kim Hong (2018). Price effect and competition coefficients of agricultural exports – the case for Vietnamese export rice, International journal of Economics and Business Research, Volume 15, Number 2, 2018, Scopus

### Tạp chí trong nước

3. Sự biến động giá và khả năng cạnh tranh của cà phê Việt Nam xuất khẩu trên thị trường thế giới. Tạp chí khoa học Trường Đại học Văn Hiến, ISSN 1859-2961, số 4 (3), 2016, trang 85-92.
4. Effect of exchange rates and gasoline price on export price of Vietnamese coffee. Journal of Science Hochiminh city Open University, ISSN 1859-3453, 2015, Number 4 (16)
5. Cải tiến công nghệ để nông sản Việt Nam vượt qua rào cản thương mại. Tạp chí khoa học và công nghệ Kinh tế - Luật và Quản lý, Đại học Quốc gia Tp. Hồ Chí Minh, ISSN 1859-0128, số 18, quý 4, 2015, trang 40-50.
6. Kiểm định đồng liên kết giữa giá cà phê Việt Nam xuất khẩu và giá cà phê Thế giới giai đoạn 2008-2014. Tạp chí khoa học Trường Đại học Mở Thành phố Hồ Chí Minh, ISSN: 1859-3453, số 4 (37), 2014.
7. Competition between US catfish and imported fish – A demand system analysis. Journal of Agricultural Science and Technology, Nong Lam University, Vietnam, Volume 4, 111-118
8. Xuất khẩu nông sản Việt Nam trong thời kỳ khủng hoảng kinh tế toàn cầu hiện nay – Thách thức và cơ hội. Từ Khủng Hoảng Đến Tái Cấu Trúc”, NXB Đại học Quốc Gia Tp.HCM

### Hội thảo quốc tế

9. Improve competitiveness of Vietnamese agriculture export companies in the world market. The 2nd International Conference on Business with Leading and Innovating Sustainable Business Development, HCM city Open university, Vietnam, October 2017
10. Measuring effects of exchange rate and world prices on export price of Vietnamese coffee. ICFE 2016 \_ The 3<sup>rd</sup> International conference on Finance and Economics, ISBN: 978-80-7454-598-6, Ton Duc Thang university, Hochiminh city, Vietnam
11. Promoting business networks for sustainable development of agricultural exports. The International conference on business 2015, HCMC, Vietnam, 27 November 2015

### Đề tài nghiên cứu khoa học

Chủ nhiệm đề tài nghiên cứu khoa học cấp trường (2015): Phân tích sự biến động giá một số mặt hàng nông sản chủ lực của Việt Nam

Thành viên đề tài NCKH cấp trường (2014): Tác động lan truyền của giá trong chuỗi giá trị của một số sản phẩm thủy sản xuất khẩu chủ lực của Việt Nam

### Hội thảo trong nước

Định vị chiến lược cạnh tranh của các quốc gia xuất khẩu gạo qua hiệu ứng giá và lượng giai đoạn 2000-2001 (2014). Chương trình nghiên cứu kinh tế Việt Nam qua các chỉ số, Đề tài cấp trường

### Sách

Đồng tác giả, Giáo trình Thống kê ứng dụng (2016), Nhà xuất bản Kinh tế



Đồng tác giả, Kinh tế lượng (2015), Nhà xuất bản Lao động