

Mô hình đánh giá tác động của các nhân tố đến kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam

Hồ Đắc Nghĩa

Trường Đại học Công nghệ TP. Hồ Chí Minh

Việc gia nhập vào các Tổ chức thương mại, ký kết các hiệp thương thương mại song phương và đa phương đã mở ra nhiều cơ hội cho Việt Nam phát huy những thế mạnh, tháo gỡ những hạn chế về thị trường xuất khẩu và tạo lập môi trường thương mại mới. Sự tăng trưởng xuất khẩu và đóng góp của nó vào sự phát triển kinh tế trong giai đoạn 2008-2018 như là một minh chứng cho thấy Việt Nam đã biết tận dụng các cơ hội này rất hiệu quả. Bài viết này sử dụng các công cụ định lượng để đánh giá tác động của các nhân tố đến kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam, trên cơ sở đó tác giả đề xuất một số kiến nghị nhằm thúc đẩy xuất khẩu hàng hóa Việt Nam trong thời gian tới, phát huy lợi thế cạnh tranh trên thị trường quốc tế.

1. Thực trạng xuất khẩu của Việt Nam giai đoạn 2008-2018

Cùng với tiến trình hội nhập kinh tế quốc tế, thị trường xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam đã được mở rộng, cơ cấu thị trường đã có sự chuyển dịch tích cực trong quá trình hội nhập quốc tế. Theo thống kê của Tổ chức Thương mại Thế giới (WTO), nếu như năm 2007, Việt Nam đứng thứ 50 thì đến năm 2017, đã vươn lên vị trí thứ 27 về xuất khẩu. Với kết quả ấn tượng của xuất nhập khẩu trong năm 2018, thứ hạng xuất khẩu, nhập khẩu của Việt Nam tiếp tục được cải thiện trên bảng xếp hạng (xếp thứ 26 về xuất khẩu), giữ vững vị trí trong số những quốc gia có tổng kim ngạch xuất nhập khẩu lớn nhất, Việt Nam liên tục nằm trong nhóm 30 nước, vùng lãnh thổ có trị giá XNK hàng hóa lớn nhất trên phạm vi toàn cầu. Trong nội khối ASEAN, Việt Nam có vị trí thứ 3 về XNK, chỉ sau Singapore và Thái Lan.

Bảng 1: Kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam giai đoạn 2008 - 2018

	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018
GTXX cả nước (tỷ USD)	62,9	56,5	71,6	96,7	114,6	132,1	150,01	162,1	176,6	214,0	243,6
Tăng trưởng XK (%)	29,5	20,2	26,5	34,2	18,2	15,4	13,7	7,9	8,9	21,8	13,3

Nguồn: Tổng cục Thống kê

Kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam đã tăng từ 96,7 tỷ USD (năm 2011) lên 243,6 tỷ USD (năm 2018), đạt tốc độ tăng trưởng bình quân 11,4%/năm trong giai đoạn 2012 - 2018. Cán cân thương mại ngày càng được cải thiện. Ở tất cả các thị trường mà Việt Nam có ký kết hiệp định thương mại tự do (FTA) đều ghi nhận tăng trưởng vượt trội, như xuất khẩu sang thị trường Hàn Quốc tăng 23,2%; Hiệp hội các quốc gia Đông Nam Á (ASEAN): tăng 13,7%; Nhật Bản tăng 12,9%; Trung Quốc tăng 18,5%... Đặc biệt, Việt Nam xuất siêu chủ yếu vào thị trường các nước phát triển, có yêu cầu khắt khe đối với hàng hóa nhập khẩu. Xuất khẩu hàng hóa của nước ta thời gian qua được mở rộng về quy

mô, đồng thời số lượng mặt hàng cũng ngày càng đa dạng và phong phú, đặc biệt đã phát triển thêm một số mặt hàng xuất khẩu chủ lực và tạo vị thế cao trong xuất khẩu các mặt hàng này.

Xét về quy mô thị trường xuất khẩu, nếu năm 2011, Việt Nam chỉ có 24 thị trường xuất khẩu, đạt kim ngạch trên 1 tỷ USD (trong đó có 3 thị trường trên 10 tỷ USD) thì đến năm 2018, có 31 thị trường xuất khẩu đạt kim ngạch trên 1 tỷ USD (trong đó, 4 thị trường đạt kim ngạch trên 10 tỷ USD, 7 thị trường trên 5 tỷ USD). Tính đến nay, hàng hóa của Việt Nam đã có mặt trên 200 quốc gia và vùng lãnh thổ. Kim ngạch xuất khẩu sang các thị trường quan trọng của Việt Nam là Hoa Kỳ, Liên minh châu Âu (EU), các quốc gia Đông Nam Á, Nhật Bản và Hàn Quốc đều tăng trưởng cao trong giai đoạn 2008-2018 Trong đó, Trung Quốc và Hàn Quốc là hai thị trường có tốc độ tăng trưởng bình quân cao nhất, với tốc độ tăng trưởng lần lượt là 21,7% và 21,5%.

Đặc biệt, 2018 là năm đạt nhiều kỷ lục về xuất khẩu hàng hóa. Số liệu của Tổng cục Hải quan cho thấy tổng trị giá hàng hóa xuất nhập khẩu của cả nước, đạt 480,17 tỷ USD, tăng hơn 52 tỷ USD so với kết quả thực hiện của năm 2017. Trong đó, xuất khẩu thiết lập những kỷ lục mới với kim ngạch đạt gần 243,5 tỷ USD, tăng 13,2% so với năm 2017, vượt xa chỉ tiêu kế hoạch được Quốc hội và Chính phủ giao. Nếu tính theo giá trị tuyệt đối, xuất khẩu năm 2018 tăng thêm 28,36 tỷ USD so với năm trước. Nhóm mặt hàng xuất khẩu lớn nhất của nước ta trong năm 2018 là điện thoại và linh kiện các loại với trị giá ghi nhận lên đến 49,1 tỷ USD, chiếm 1/5 tổng trị giá hàng xuất khẩu.

Năm 2018 cũng là năm thứ 3 liên tiếp xuất siêu của Việt Nam, khi mức thặng dư kỷ lục lên gần 6,8 tỷ USD (cao hơn rất nhiều so với năm 2016 là 1,78 tỷ USD và năm 2017 là 2,11 tỷ USD). Trong năm 2018, Việt Nam

có thặng dư cán cân thương mại với 150 nước, vùng lãnh thổ và có thâm hụt với 85 nước, vùng lãnh thổ. Về việc duy trì xuất siêu, Việt Nam đã đạt xuất siêu trong 6 năm kể từ năm 2012 đến nay, chỉ duy nhất năm 2015 có cán cân thương mại thâm hụt. Kết quả này đã góp phần cân bằng cán cân thanh toán và ổn định các chỉ số kinh tế vĩ mô của nền kinh tế.

Tuy nhiên, hoạt động xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam chỉ mới thiên về bề nổi, còn xét về mặt chất thì xuất khẩu của nước ta còn gặp nhiều hạn chế: cơ cấu hàng hóa xuất khẩu vẫn chủ yếu tập trung vào xuất khẩu những sản phẩm thô, phụ thuộc rất nhiều vào nguồn nguyên liệu nhập khẩu dẫn đến giá trị xuất khẩu hàng hóa không cao, cơ cấu thị trường xuất khẩu, vấn đề thâm hụt cán cân thương mại,... Đây chính là các thách thức mà các nhà nghiên cứu kinh tế cần quan tâm để tìm ra giải pháp phù hợp.

2. Mô hình hồi quy số liệu mảng

Dữ liệu mảng là dữ liệu được quan sát trên một tập n đối tượng và mỗi đối tượng (i) được quan sát tại ni thời điểm liên tiếp tính từ t0. Nếu mọi ni bằng nhau thì ta gọi là tập dữ liệu mảng cân bằng, trường hợp ngược lại thì dữ liệu mảng được gọi là dữ liệu mảng không cân bằng. Mô hình hồi quy với số liệu mảng là mô hình hồi quy hai chiều có dạng như sau:

$$Y_i = \alpha + \sum_{j=1}^n \beta_j X_{ij} + c_i + u_{iv}$$

Có hai biểu diễn của mô hình hồi quy số liệu mảng tương ứng với 2 trường hợp:

+ Mô hình tác động cố định FE (Fixed Effects) giả thiết rằng các hệ số chặn của mô hình đối với các cá thể là khác nhau.

+ Mô hình tác động ngẫu nhiên RE (Random Effects) giả thiết rằng các hệ số chặn của mô hình đối với các cá thể là như nhau, phần khác nhau của các cá thể là ngẫu nhiên và vì vậy được gộp vào sai số ngẫu nhiên u.

3. Dữ liệu nghiên cứu

Nguồn số liệu: số liệu sử dụng để kiểm định và ước lượng mô hình đánh giá tác động của các nhân tố đến kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam là nguồn số liệu thứ cấp, được thu thập từ nguồn dữ liệu của Tổng cục thống kê, Ngân hàng thế giới (World bank), Quỹ Tiền tệ Quốc tế (IMF), trong giai đoạn 2008 — 2018 của các nước trong khối ASEAN và các quốc gia: Nhật, Hàn Quốc, Trung Quốc, Mỹ, EU.

Các biến số trong mô hình bao gồm các chỉ tiêu tài chính được ký hiệu và giải thích như sau:

- + Biến GDPVN: tổng sản phẩm quốc nội của Việt Nam (tỷ USD).
- + Biến DSVN : dân số của Việt Nam (triệu người).
- + Biến FTA: là biến giả. Nhận giá trị 1 nếu Việt Nam

và quốc gia nhập khẩu cùng ký hiệp định thương mại song phương, nhận giá trị 0 trong trường hợp ngược lại.

+ Biến EXG : tỉ giá hối đoái.

+ Biến EXijt : giá trị xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam (tỷ USD) tới nước j trong năm t.

4. Ước lượng và kiểm định

Mô hình đánh giá tác động của các nhân tố đến kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam giai đoạn 2008 - 2018 được tác giả đề xuất như sau:

$$\ln EX_{jt} = \beta_0 + \beta_1 \ln GDPVN_t + \beta_2 \ln GDP_{jt} + \beta_3 \ln DSVN_t + \beta_4 \ln DS_{jt} + \beta_5 \ln EXG_{jt} + \beta_6 FTA + u_{it}$$

Tiến hành quy trình ước lượng với dữ liệu mảng trên phần mềm thống kê STATA, dữ liệu giai đoạn 2008- 2018 để ước lượng các mô hình: mô hình POLS; mô hình random effects (RE); mô hình fixed effects (FE) và tiến hành kiểm định Hausman để quyết định lựa chọn mô hình. Kết quả cho thấy mô hình random effects (RE) là phù hợp nhất (do P — value >0.05).

Kiểm định tự tương quan trong mô hình bằng lệnh “xttest1”, kết quả cho thấy giá trị P — value=0.528 >0.05, vì vậy mô hình này không có hiện tượng tự tương quan.

Kiểm định phương sai sai số thay đổi bằng lệnh “xttest3”, kết quả cho thấy giá trị P — value=0, vì vậy mô hình này có hiện tượng phương sai sai số thay đổi. Hậu quả của phương sai sai số thay đổi sẽ làm cho kết quả kiểm định, các khoảng tin cậy của các hệ số ước lượng không còn được chính xác nữa. Tiến hành khắc phục hiện tượng này bằng lệnh “robust”, thu được kết quả sau hiệu chỉnh là:

Bảng 2. Ước lượng mô hình sau hiệu chỉnh

ln EX	Coef.	Std. Err.	P > z
ln GDPVN _t	2.0111	0.0065532	0.000
ln GDP _{jt}	0.3803	0.0132411	0.012
ln DSVN _t	-5.7547	0.0125841	0.38
ln DS _{jt}	0.3922	0.180002	0.57
ln EXG _{jt}	-0.2891	0.037236	0.02
FTA	-0,0916	0.026425	0,49
_cons	14.4813	3205.166	0.028

Dựa vào kết quả trong bảng kết quả ước lượng mô hình sau hiệu chỉnh, ta có phương trình ước lượng:

$$\ln EX_{jt} = 14,481 + 2,011 \ln GDPVN_t + 0,38 \ln GDP_{jt} - 5,754 \ln DSVN_t + 0,392 \ln DS_{jt} - 0,289 \ln EXG_{jt} - 0,091 FTA$$

Từ kết quả trên, ta rút ra một số nhận xét như sau:

+ Hệ số ước lượng của biến GDPVN trong mô hình mang dấu dương; có ý nghĩa thống kê, tức là sự tăng lên của tổng sản phẩm quốc nội của Việt Nam có tác động tích cực đến kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam. Cụ thể, với điều kiện các yếu tố khác không đổi, khi tổng sản phẩm quốc nội của Việt Nam tăng lên 1% thì tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam trong chu kỳ 2008 — 2018 tăng lên 2.011%. Điều này cho thấy, khi quy mô nền kinh tế

tăng lên, Việt Nam có điều kiện nâng cao kỹ thuật, công nghệ mới góp phần gia tăng kim ngạch xuất khẩu hàng hóa.

+ Hệ số ước lượng của biến GDP trong mô hình mang dấu dương; có ý nghĩa thống kê, tức là sự tăng lên của GDP các nước nhập khẩu có tác động tích cực đến kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam. Cụ thể, với điều kiện các yếu tố khác không đổi, khi GDP các nước nhập khẩu tăng lên 1% thì tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam trong chu kỳ đó sẽ tăng lên 0,38%. Điều này hoàn toàn phù hợp với thực tế bởi vì đối với các nước nhập khẩu hàng hóa của Việt Nam thì việc tăng quy mô nền kinh tế (GDP) sẽ làm cho nhu cầu nhập khẩu hàng hóa để sản xuất và tiêu dùng của quốc gia đó sẽ gia tăng, qua đó làm kim ngạch nhập khẩu.

+ Hệ số ước lượng của biến DSVN trong mô hình mang dấu âm; không có ý nghĩa thống kê. Điều này cho thấy sự biến động của dân số Việt Nam không làm ảnh hưởng đến tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam trong chu kỳ 2008 — 2018.

+ Hệ số ước lượng của biến DS trong mô hình mang dấu dương; không có ý nghĩa thống kê, hệ số ước lượng này cho thấy biến dân số của các nước nhập khẩu hàng hóa Việt Nam không giải thích được cho biến tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam trong chu kỳ nghiên cứu. Như vậy, dân số của Việt Nam và dân số của các nước nhập khẩu không có tác động đến tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam.

+ Hệ số ước lượng của biến EX trong mô hình mang dấu âm; có ý nghĩa thống kê, tức là sự tăng lên của tỷ giá hối đoái có tác động rất lớn đến giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam. Cụ thể, với điều kiện các yếu tố khác không đổi, khi tỷ giá hối đoái trong chu kỳ tăng lên 1% thì tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam trong chu kỳ đó sẽ giảm đi 0,28%. Điều này cho thấy khi tỷ giá hối đoái càng gia tăng thì giá trị đồng nội tệ của Việt Nam ngày càng bị mất giá, từ đó làm ảnh hưởng đến hoạt động xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam.

+ Hệ số ước lượng của biến FTA trong mô hình mang dấu âm; không có ý nghĩa thống kê, tức là trong số các quốc gia đối tác của Việt Nam khi tham gia FTA trong chu kỳ 2008 — 2018 chưa có các tác động đến hoạt động xuất khẩu của Việt Nam.

5. Kết luận và giải pháp

Dựa trên các số liệu thống kê cho thấy tổng giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam không ngừng gia tăng liên tục trong những năm qua. Bên cạnh những kết quả đáng ghi nhận, hoạt động xuất khẩu hàng hóa của Việt Nam vẫn còn tồn tại một số hạn chế: giá trị kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam tuy có gia tăng nhưng vẫn còn ở mức thấp, không đáng kể

so với một số quốc gia trong khu vực và của thế giới; Cơ cấu các mặt hàng xuất khẩu có hàm lượng công nghệ thấp; Xuất khẩu hàng hóa sang các thị trường lớn như: Mỹ, Châu Âu,... vẫn còn gặp nhiều khó khăn vướng mắc.

Theo kết quả nghiên cứu, để duy trì và nâng cao giá trị kim ngạch xuất khẩu hàng hóa thì phải chú trọng thúc đẩy phát triển và tăng trưởng kinh tế trong nước bằng cách thường xuyên mở rộng quy mô sản xuất trong nước theo định hướng xây dựng một chuỗi liên kết của các doanh nghiệp tham gia xuất khẩu hàng hóa, không ngừng đầu tư đổi mới công nghệ, triển khai áp dụng các quy trình sản xuất theo công nghệ nước ngoài.

Kết quả nghiên cứu cũng đã cho thấy dân số Việt Nam có tác động không đáng kể đến kim ngạch xuất khẩu do năng suất lao động chưa cao. Trên thực tế, Việt Nam được đánh giá là nước có lợi thế về nguồn lao động. Tuy nhiên, chất lượng lao động lại đang là trở ngại lớn cho Việt Nam khi tham gia cạnh tranh quốc tế. Do đó, để tăng giá trị kim ngạch xuất khẩu thì Việt Nam cần chú trọng đầu tư phát triển công tác đào tạo kiến thức về toàn cầu hóa, xu thế hội nhập, kinh tế thị trường, phát triển khoa học kỹ thuật, công nghệ,... cho lực lượng lao động. Tăng cường kinh phí đào tạo đội ngũ cán bộ nghiên cứu khoa học ở trong và ngoài nước.

Có thể thấy rằng nếu tiến hành phá giá VND thì không chắc giúp Việt Nam tăng được giá trị kim ngạch xuất khẩu mà còn tạo ra nguy cơ nhập khẩu lạm phát, đối với những hàng hóa được sản xuất cho mục đích sử dụng trong nước nhưng phải nhập khẩu nguyên vật liệu. Trong trường hợp cần thiết phải phá giá VND thì phải tính đến yếu tố tâm lý — yếu tố luôn mang tính quyết định tại Việt Nam. Làm sao để các thành phần kinh tế thấy được việc phá giá là cần thiết và sẽ không kỳ vọng việc tiếp tục phá giá. Vì thế, việc áp dụng chính sách tỷ giá cần được thực hiện một cách linh hoạt cân cứ vào diễn biến thực tế của nền kinh tế trong từng thời kỳ để hoạt động xuất khẩu hàng hóa đạt được hiệu quả cao./.

Tài liệu tham khảo

Nguyễn Quang Đông, Nguyễn Thị Minh (2012), Giáo trình kinh tế lượng, Nhà xuất bản Đại học Kinh tế Quốc dân.

Phạm Ngọc Linh, Nguyễn Thị Kim Dung (2008), Giáo trình kinh tế phát triển, Nhà xuất bản Đại học Kinh tế Quốc dân.

Hoàng Đình Minh (2013), Ảnh hưởng của tỷ giá đến xuất, nhập khẩu tại Việt Nam, Tạp chí Tài chính — Bộ Tài chính.

Doãn Công Khánh (2019), Nâng cao năng lực cạnh tranh cho các mặt hàng xuất khẩu chủ lực. Tạp chí Cộng sản — Bộ Công thương.