

PHÂN TÍCH ĐỊNH LƯỢNG TÁC ĐỘNG CỦA XUẤT KHẨU HÀNG HÓA TỚI TĂNG TRƯỞNG KINH TẾ

Để có thêm cái nhìn khách quan và rõ ràng hơn về tác động của xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế Việt Nam, mô hình nghiên cứu định lượng được xây dựng nhằm phân tích ảnh hưởng động (dynamic effects) của xuất khẩu hàng hóa cả ở khía cạnh lượng (xuất khẩu ở mức tổng) và chất (chất lượng cơ cấu hàng hóa xuất khẩu) tới tăng trưởng kinh tế. Mô hình nghiên cứu được xây dựng dựa trên hàm sản xuất Cobb-Douglas mở rộng. Các biến được đưa vào mô hình trên cơ sở lý thuyết và nghiên cứu thực nghiệm về tác động của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế và có sự điều chỉnh nhất định cho phù hợp với điều kiện thực tiễn tại Việt Nam.

Dữ liệu phục vụ nghiên cứu được thu thập từ nguồn số liệu của Tổng cục Thống kê. Trong đó, thống kê các mặt hàng xuất khẩu chủ yếu được sử dụng để tính toán các chỉ số trước, khi đưa vào mô hình ước lượng.

1. Các biến số

Tăng trưởng kinh tế (G): sử dụng tốc độ tăng trưởng GDP làm đại diện, kế thừa từ một số nghiên cứu gần đây như Phan Minh Ngọc, và cộng sự (2003), Avvokuse(2008), Mishra (2012).

Lao động (GL): Sử dụng tốc độ tăng lực lượng lao động làm đại diện. Mô hình xét đến lực lượng lao động chứ không phải toàn bộ dân số, bởi chính lực lượng lao động mới là đối tượng thực sự tạo ra giá trị gia tăng cho nền kinh tế. Cách xác định biến lao động như vậy được sử dụng trong nghiên cứu gồm Eanayiotis và Christopolos (2005); Rahmadi, Ichihashi (2011)

Kế thừa, nghiên cứu của Phan Minh Ngọc Panayiotis và Christopoulòs (2005), Hesse (2008) cũng sử dụng cách xác định này với biến K.

Ngoài các biến tăng trưởng kinh tế(G), lao động (GL), vốn vật chất (K), các biến thể hiện thuộc tính của xuất khẩu được xác định như sau:

Xuất khẩu ở mức tổng (EX): Sử dụng tỷ lệ xuất này được sử dụng trong nghiên cứu của Richard (2001), Phan Minh Ngọc và cộng sự (2003).

Biến số phản ánh ảnh hưởng của các nhóm hàng xuất khẩu, gồm có:

EXT. Tỷ lệ kim ngạch xuất khẩu hàng thô và sơ chế/GDP.

EX2: Tỷ lệ kim ngạch xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng lao động/GDP.

EX3: Tỷ lệ kim ngạch xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng kỹ năng/GDP.

Nghiên cứu kế thừa cách phân loại của Mayer và Wood (2001) để sắp xếp các mặt hàng vào các nhóm hàng thô và sơ chế, hàng thâm dụng lao động, hàng thâm dụng kỹ năng. Sử dụng tỷ lệ xuất khẩu của các nhóm hàng/GDP làm đại diện vừa phản ánh được tầm quan trọng của các nhóm trong giỏ hàng hóa xuất khẩu, vừa thể hiện được tầm quan trọng của các nhóm này với tổng sản lượng của nền kinh tế.

Mức độ đa dạng hóa của giỏ hàng hóa xuất khẩu: Đánh giá qua hai thước đo được sử dụng rộng rãi hiện nay là chỉ số Herfindahl và chỉ số Theil Entropy.

Chỉ số Herfindahl (HI) được xác định theo công thức:

Trong đó: S_i là tỷ trọng các nhóm hàng trong tổng cơ cấu hàng hóa xuất khẩu, n là số nhóm hàng xuất khẩu. HI dao động trong khoảng từ 0 đến 1 và càng gần 1 thì cơ cấu hàng hóa xuất khẩu càng có mức độ chuyên môn hóa cao, đồng nghĩa với mức đa dạng hóa thấp. Chỉ số Herfindahl được sử dụng trong các nghiên cứu gần đây của Mansor và Amin (2003), United Nations (2004), Lim và Saborowski (2011) cách xác định của Taylor và Francis (2003), Lim và Saborowski (2011). Chỉ số này được xác định

Chỉ số Theil Entropy (T): được tính toán theo công thức:

Chỉ số Theil Entropy biến động từ 0 đến $\ln(n)$, T càng cao đồng nghĩa với giỏ hàng hóa xuất khẩu có mức độ đa dạng hóa cao, tức là mức độ chuyên môn hóa thấp.

Ưu điểm của chỉ số Theil là có thể tách ảnh hưởng của đa dạng hóa theo chiều rộng T_w (đa dạng hóa trong nội bộ nhóm hàng) và đa dạng hóa theo chiều sâu T_b (đa dạng hóa giữa các nhóm hàng). Theo đó, T có thể được viết lại như sau:

$$T = T_w + T_b$$

Cũng với cách phân loại hàng hóa theo cách tiếp cận của Mayer và Wood (2001), đa dạng hóa theo chiều rộng trong nghiên cứu được hiểu là mở rộng xuất khẩu diễn ra trong nội bộ các nhóm hàng thô và sơ chế, chế biến thâm dụng lao động và chế biến thâm dụng kỹ năng, còn đa dạng hóa theo chiều sâu hàm ý về

sự chuyển dịch cơ cấu xuất khẩu từ hàng hóa thô và sơ chế sang hàng hóa chế biến thâm dụng lao động và hàng chế biến thâm dụng kỹ năng.

Mức độ ổn định của cơ cấu hàng hóa xuất khẩu (CXS): Xác định theo nghiên cứu của Mansor và Amin (2003), nhằm đánh giá mức độ thích ứng của xuất khẩu hàng hóa, trong mối quan hệ với tăng trưởng kinh tế, trước các cú sốc trong và ngoài nước.

Biến giả phản ánh sự thay đổi cấu trúc tác gồm:

Biến giả DO7: là biến định tính, nhận giá trị bằng 0 nếu quan sát nằm trong giai đoạn 2000-2006 và nhận giá trị bằng 1 nếu quan sát nằm trong giai đoạn 2007-2012, để đánh giá liệu có sự khác biệt về tăng trưởng kinh tế giữa các giai đoạn trước và từ khi Việt Nam trở thành thành viên của WTO hay không.

Biến giả D07EX: là biến tương tác giữa xuất khẩu và biến giả D07, đánh giá sự thay đổi về cấu trúc trong tác động của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế, hàm ý liệu có sự khác biệt về tác động của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế giữa hai giai đoạn kể trên hay không.

Như vậy, có năm nhóm biến số phản ánh tác động của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế: (1) Xuất khẩu hàng hóa ở mức tổng (EX); (2) Xuất, khẩu theo các nhóm hàng (EX1, EX2, EX3); (3) Mức độ đa dạng hóa (HI, T, Tb, Tw); (4) Mức độ ổn định của xuất khẩu (CXS); (5) Biến số thể hiện sự thay đổi về cấu trúc trong tác động (D07EX).

2. Phương pháp phân tích

Phân tích được thực hiện theo hai bước sau: (1) Kiểm định mối quan hệ nhân quả giữa các cặp biến tăng trưởng - xuất khẩu; (2) Ước lượng tác động trong các phương trình hồi quy.

2.1. Kiểm định mối quan hệ nhân quả giữa các cặp biến tăng trưởng - xuất khẩu

Quan hệ giữa xuất khẩu và tăng trưởng kinh tế có thể là nhân quả một chiều hoặc hai chiều nên trước khi ước lượng, nghiên cứu thực hiện các kiểm định nhân quả với lần lượt các cặp biến tăng trưởng - xuất khẩu. Kiểm định nhân quả Granger được thực hiện trong các phương trình có dạng:

$$G_t = a + \sum_{i=1}^m \alpha_i G_{t-i} + \sum_{i=1}^m \beta_i X_{t-i} + \mu_t$$

$$X_t = b + \sum_{i=1}^k \gamma_i G_{t-i} + \sum_{i=1}^l \beta_i X_{t-i} + \mu_t$$

Trong đó G_t là tốc độ tăng trưởng kinh tế và X_t đại diện cho xuất khẩu, lần lượt được thay thế bằng các biến thể hiện các đặc trưng của xuất khẩu.

2.2. Các phương trình hồi quy

Các phương trình hồi quy thực nghiệm được xây dựng dựa trên hàm sản xuất Cobb-Douglas mở rộng với tiến bộ I công nghệ theo trung lập Hicks, nội sinh và lợi suất không đổi theo quy mô:

$$Y_t = A_t K_t^\alpha L_t^\beta$$

Trong đó Y_t đại diện tổng sản lượng của nền kinh tế thời kỳ t ; A_t là năng suất nhân tố tổng hợp; K_t , L_t lần lượt là các mức tích lũy vốn và tích lũy lao động; α , β là các hằng số trong khoảng từ 0 đến 1 lần lượt đo lường đóng góp của vốn và lao động vào sản lượng.

Từ đó, A_t có thể được viết lại là một hàm của xuất khẩu và các nhân tố ngoại sinh khác (C_t), được giả định không tương quan với xuất khẩu:

$$A_t = (EX_t, EX1_t, EX2_t, EX3_t, HI_t, T_t, Tbt, Twt, CXSt, C_t)$$

Các biến trong mô hình có tác động trễ, nên nghiên cứu sử dụng mô hình hồi quy động có trễ phân phối để ước lượng, vì mô hình này không chỉ cho biết tác động tức thời của biến giải thích lên biến phụ thuộc, mà còn cho biết tác động tích lũy theo thời gian, bao gồm tác động dài hạn.

Các biến trễ của biến phụ thuộc cũng được đưa vào mô hình nhằm bảo đảm độ tin cậy cao hơn so với những mô hình không có biến trễ của biến phụ thuộc, mà vẫn giữ được động thái lâu dài của tăng trưởng kinh tế. Các phương trình ước lượng cụ thể sau khi đã được tuyến tính hóa như sau:

Phương trình 1: Tác động của xuất khẩu ở mức tổng tới tăng trưởng kinh tế.

$$G_t = \alpha_{1i} + \sum_{i=1}^k \alpha_{2i} G_{t-i} + \sum_{i=0}^k \alpha_{3i} K_{t-i} + \sum_{i=0}^k \alpha_{4i} L_{t-i} + \sum_{i=0}^k \alpha_{5i} EX_{t-i} \\ + \sum_{i=0}^k \alpha_{6i} HI_{t-i} + \sum_{i=0}^k \alpha_{7i} CXS_{t-i} + \sum_{i=0}^k \alpha_{8i} D07 + \sum_{i=0}^k \alpha_{9i} D07EX \\ + u_{t1}$$

Phương trình 2: Tác động của xuất khẩu các nhóm hàng tới tăng trưởng kinh tế

$$G_t = \beta_{1i} + \sum_{i=1}^k \beta_{2i} G_{t-i} + \sum_{i=0}^k \beta_{3i} K_{t-i} + \sum_{i=0}^k \beta_{4i} L_{t-i} + \sum_{i=0}^k \beta_{5i} EX_{t-i} \\ + \sum_{i=0}^k \beta_{6i} EX2_{t-i} + \sum_{i=0}^k \beta_{7i} EX3_{t-i} + \sum_{i=0}^k \beta_{8i} HI_{t-i} + \sum_{i=0}^k \beta_{9i} CXS_{t-i} \\ + u_{t2}$$

Phương trình 3: Tác động của đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu sử dụng chỉ số Theil Entropy.

$$G_t = \lambda_{1i} + \sum_{i=1}^k \lambda_{2i} G_{t-i} + \sum_{i=0}^k \lambda_{3i} K_{t-i} + \sum_{i=0}^k \lambda_{4i} L_{t-i} + \sum_{i=0}^k \lambda_{5i} EX_{t-i} + \sum_{i=0}^k \lambda_{6i} T_{t-i} \\ + \sum_{i=0}^k \lambda_{7i} CXS_{t-i} + u_{t3}$$

Phương trình 4: Tác động của đa dạng hóa trong nội bộ nhóm hàng theo chiều r

$$G_t = \omega_{1i} + \sum_{i=1}^k \omega_{2i} G_{t-i} + \sum_{i=0}^k \omega_{3i} K_{t-i} + \sum_{i=0}^k \omega_{4i} L_{t-i} + \sum_{i=0}^k \omega_{5i} EX_{t-i} \\ + \sum_{i=0}^k \omega_{6i} TB_{t-i} + \sum_{i=0}^k \omega_{7i} TW_{t-i} + \sum_{i=0}^k \omega_{8i} CXS_{t-i} + u_{t4}$$

3. Kết quả nghiên cứu

3.1. Hiệu chỉnh mùa vụ và kiểm định tính dừng của các chuỗi số liệu

Thông thường, hầu hết mọi số liệu kinh tế báo cáo bởi các cơ quan thống kê trên thế giới đều ở cả hai dạng: đã hiệu chỉnh yếu tố mùa vụ và chưa hiệu

chỉnh mùa vụ. Tuy nhiên, các số liệu thống kê ở Việt Nam hiện nay hầu hết ở dạng chưa hiệu chỉnh mùa vụ. Với chuỗi thời gian có tần suất theo quý, yếu tố mùa vụ thường xuất hiện và cần được loại bỏ để tránh ảnh hưởng đến đặc tính thật của chuỗi số liệu. Ở đây nghiên cứu hiệu chỉnh mùa vụ bằng phương pháp trung bình trượt. Sau đó, các chuỗi số liệu được kiểm định tính dừng bằng kiểm định ADF. Độ trễ trong kiểm định ADF được lựa chọn dựa trên chỉ tiêu AIC và để AIC tự động lựa chọn độ trễ thích hợp. Kiểm định ADF với các biến này cho thấy các chuỗi số đều không dừng (ngoại trừ GL). Lấy sai phân bậc nhất các biến không dừng, ta có:

DGSA, DKSA: tương ứng là sai phân bậc nhất của tăng trưởng kinh tế và của đầu tư/GDP sau khi đã hiệu chỉnh mùa vụ.

DEXSA, DEXISA, DEX2SA, DEX3SA, DHISA, DTSA, DTBSA, DTWSA, DCXSSA: tương ứng là sai phân bậc nhất của các biến thể hiện các đặc trưng của xuất khẩu sau khi đã hiệu chỉnh mùa vụ.

Thực hiện kiểm định ADF với các chuỗi sau khi biến đổi được kết quả tất cả các chuỗi đều dừng với mức ý nghĩa 1%. Các chuỗi dừng này được đưa vào kiểm định nhân quả và ước lượng trong nhóm mô hình hồi quy.

3.2. Kết quả ước lượng

Bảng kết quả kiểm định nhân quả

| Các biến | Chỉ-sq | P-value | Kết luận |
|---------------|--------|---------|-----------------------------------------|
| DGSA ► DEXSA | 7,6 | 0,58 | DGSA không tác động nhân quả tới DEXSA |
| DGSA § DEXSA | 15,4 | 0,08 | DEXSA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA § EX1SA | 7,3 | 0,20 | DGSA không tác động nhân quả tới DEX1SA |
| DGSA - EX1SA | 10,5 j | 0,06 | DEX1SA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA ► DEX2SA | 1,74' | 0,62 | DGSA không tác động nhân quả tới DEX2SA |

| | | | |
|---------------|------|------|-----------------------------------------|
| DGSA 4 DEX2SA | 11,0 | 0,01 | DEX2SA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA ► DEX3SA | 6,0 | 0,87 | DGSA không tác động nhân quả tới DEX3SA |
| DGSA ◀ DEX3SA | 23,6 | 0,01 | DEX3SA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA ► DHISA | 1,6 | 0,63 | DGSA không tác động nhân quả tới DHISA |



| Các biến | Chi-sq | p-value | Kết luận |
|------------------|--------|---------|-----------------------------------------|
| DGSA +- DHISA | 8,6 | 0,03 | DHISA tác động nhân quả tới DGSA |
| pGSA ^ DTSA | 8,4 | 0,49 | DGSA không tác động nhân quả tới DTSA |
| DGSA < - DTSA | 17,7 | 0,03 | DTSA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA -- ► DTBSA | 5,4 | 0,70 | DGSA không tác động nhân quả tới DTBSA |
| DGSA ◀ DTBSA | 21,0 | 0,00 | DTBSA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA - ► DTWSA | 3,1 | 0,87 | DGSA không tác động nhân quả tới DTWSA |
| DGSA ◀ DTWSA | 22,2 | 0,00 | DTWSA tác động nhân quả tới DGSA |
| DGSA -- ► DCXSSA | | 0,75 | DGSA không tác động nhân quả tới DCXSSA |
| DGSA ◀-- DCXSSA | 12,2 | 0,01 | DCXSSA tác động nhân quả tới DGSA |

Nguồn: Tính toán của tác giả.

Kiểm định cho thấy, giữa xuất khẩu hàng hóa và tăng trưởng kinh tế có mối quan hệ nhân quả một chiều, từ phía xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế. Từ

đó, các biến được đưa vào phương trình hồi quy, ước lượng theo phương pháp OLS truyền thống. Những tham số không có ý nghĩa thống kê được loại bỏ dần khỏi mô hình. Độ trễ của các biến trong mỗi phương trình phải đủ lớn để đảm bảo sai số không có tự tương quan và không có phương sai thay đổi.

Bảng kết quả hồi quy

| Phương trình 1 | | | Phương trình 2 | | |
|----------------------------------|---------|-----------|----------------------------------|---------|-----------|
| Biến giải thích | Tham số | Giá trị p | Biến giải thích | Tham số | Giá trị p |
| c | -0,001 | 0,391 | c | -0,001 | 0,040 |
| DGSA(-2) | 0,275 | 0,016 | DGSA(-2) | 0,183 | 0,084 |
| DKSA(-7) | -0,026 | 0,004 | DEXISA(-3) | -0,012 | 0,001 |
| DKSA(-8) | -0,034 | 0,000 | DEX2SA(-1) | 0,097 | 0,000 |
| DEXSA(-8) | 0,011 | 0,001 | DEX2SA(-6) | -0,053 | 0,004 |
| DHISA(-7) | -0,046 | 0,068 | DEX2SA(-7) | -0,074 | 0,000 |
| DHISA(-8) | -0,063 | 0,029 | DEX3SA(-3) | 0,122 | 0,014 |
| DCXSSA(-4) | 0,019 | 0,022 | DHISA(-7) | -0,079 | 0,001 |
| DCXSSA(-6) | 0,021 | 0,017 | DHISA(-8) | -0,073 | 0,006 |
| DCXSSA(-7) | 0,025 | 0,005 | DCXSSA(-4) | 0,024 | 0,003 |
| DCXSSA(-8) | 0,019 | 0,037 | DCXSSA(-7) | 0,036 | 0,000 |
| R ² hiệu chỉnh = 0.60 | | | R ² hiệu chỉnh = 0.68 | | |
| Kiểm định tự tương quan (LM): | | | Kiểm định tự tương quan (LM): | | |
| Thống kê F=0,48; | | | Thống kê F=0,67; Giá trị | | |
| Giá trị p-F(4,27) = 0,75 | | | p-F(4,27)=0,62 | | |

Thống kê kiểm định phương sai sai

Thống kê kiểm định phương sai sai

số thay đổi (ARCH): Thống kê F =

số thay đổi (ARCH): Thống kê F =

1,27; Giá trị p-F(4,33) = 0,30

0,76; Giá trị p-F(4,33) = 0,56

| Phương trình 3 | | | Phương trình 4 | | |
|-----------------|---------|-----------|-----------------|---------|-----------|
| Biến giải thích | Tham số | Giá trị p | Biến giải thích | Tham số | Giá trị p |
| G | -0,000 | 0,717 | c | -0,000 | 0,659 |
| DGSA(-2) | 0.198 | 0.065 | DGSA(-2) | 0.176 | 0.08 |
| DKSA(-7) | -0.022 | 0.012 | DKSA(-7) | -0.024 | 0.006 |
| DKSA(-8) | -0.040 | 0.000 | DKSA(-8) | -0.036 | 0.000 |
| DEXSA(-8) | 0.012 I | 0.001 | DEXSA(-8) | 0.011 | 0.000 |
| DTSA(-3) | -0.010 | 0.056 | DTWSA(-1) | 0.011 | 0.085 |
| DTSA(-8) | 0.013 | 0.049 | DTWSA(-3) | -0.021 | 0.001 |
| DCXSSA(-4) | 0.025 | 0.004 | DTWSA(-7) | 0.018 | 0.045 |
| DCXSSA(-Ô) | 0.020 | 0.018 | 1 DTWSA(-8) | 0.031 | 0.005 |
| DCXSSA(-7) | 0.030 | 0.001 | DCXSSA(-4) | 0.023 | 0.004 |
| DCXSSA(-8) | 0.024 | 0.005 | DCXSSA(-6) | 0.024 | 0.004 |
| | | | DCXSSA(-7) | 0.028 | 0.001 |
| | | | DCXSSA(-8) | 0.019 | 0.022 |

R² hiệu chỉnh = 0,61 Kiểm định tự tương quan (LM): Thống kê F=0,08;

R² hiệu chỉnh ~ 0,68 Kiểm định tự tương quan (LM): Thống kê F=0,31;

Giá trị p-F(4,27) = 0,99 Thống kê kiểm định phương sai sai số thay đổi (ARCH): Thống kê F =. 0,96; Giá trị

Giá trị p-F(4,27) = 0,68 Thống kê kiểm định phương sai sai số thay đổi (ARCH): Thống kê F =L 0,11; Giá trị p-F(4,33)>= 0,98

Bảng Tác động của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế Việt Nam

| Nội dung cần kiểm định | Tác động tức thời | Tác động dài hạn |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|------------------|
| Tác động của xuất khẩu hàng hóa ở mức tổng tới tăng trưởng kinh tế | | + |
| Tác động của xuất khẩu hàng thô và sơ chế tới tăng trưởng kinh tế | - | - |
| Tác động của xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng lao động tới tăng trưởng kinh tế | +/- | - |
| Tác động của xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng kỹ năng tới tăng trưởng kinh tế | + | + |
| Tác động của đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế | | |
| Tác động của đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu theo chiều rộng tới tăng trưởng kinh tế | + | + |
| Tác động của đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu theo chiều sâu tới tăng trưởng kinh tế | Chưa tìm thấy bằng chứng về tác động | |
| Tác động của mức độ ổn định cơ cấu hàng hóa xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế | + | + |
| Sự khác biệt về tác động của xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế trước và từ khi Việt Nam gia nhập WTO | Chưa có bằng chứng khác | |

Nguồn: Tổng hợp từ kết quả ước lượng của tác giả.

4. Luận giải kết quả nghiên cứu

4.1. Tác động của xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế

Tham số của biến $DEXSA > 0$ trong các phương trình 1, 3 và 4, nghĩa là tỷ lệ xuất khẩu/GDP tăng thêm có ảnh hưởng tích cực tới tăng trưởng kinh tế trong điều kiện các nhân tố khác không đổi. Kết quả này ủng hộ giả thuyết tăng trưởng kinh tế hướng về xuất khẩu, phần nào cho thấy thúc đẩy xuất khẩu trong những năm qua là một trong những động lực của tăng trưởng kinh tế Việt Nam, không

chỉ bởi các con số ấn tượng về quy mô xuất khẩu, mà còn vì ảnh hưởng tích cực của xuất khẩu tới khả năng duy trì tăng trưởng kinh tế trong dài hạn. Tác động này là khá nhỏ và có độ trễ khá lớn. Tuy nhiên, phương trình ước lượng ảnh hưởng của xuất khẩu qua tác động tới TFP. Do đó, trong bối cảnh đóng góp của TFP nói chung vào tăng trưởng kinh tế có xu hướng giảm sút trong những năm gần đây thì tác động tích cực này là tín hiệu đáng khích lệ.

Các thuộc tính phản ánh chất lượng cơ cấu hàng hóa xuất khẩu có tác động khá đa dạng và đan xen, phản ánh một số khía cạnh bản chất về tác động của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế

4.2. Tác động tiêu cực của xuất khẩu hàng hóa thô và sơ chế tới tăng trưởng kinh tế

Tham số của biến $DEXISA < 0$ trong phương trình 2 cho thấy ảnh hưởng tiêu cực của gia tăng xuất khẩu hàng thô và sơ chế tới tăng trưởng kinh tế. Kết quả này cũng phù hợp với lý thuyết và thực tiễn tại Việt Nam. Về lý thuyết, xuất khẩu hàng thô và sơ chế được coi là bất lợi cả về phía cung và phía cầu, ảnh hưởng lan tỏa đến nền kinh tế hạn chế hơn nhiều so với hàng hóa chế biến. Tuy nhiên, với các nước đang phát triển, điều kiện trình độ sản xuất còn thấp, đặc biệt là trình độ của ngành công nghiệp và khả năng tích lũy vốn của nền kinh tế còn hạn chế thì chiến lược xuất khẩu sản phẩm thô, sử dụng rộng rãi các nguồn tài nguyên sẵn có và các điều kiện thuận lợi của đất nước là kịch bản khá quen thuộc. Đối với Việt Nam, chiến lược xuất khẩu sản phẩm thô cũng đã góp phần quan trọng trong việc tạo nguồn vốn ban đầu cho công nghiệp hóa. Vấn đề là ở chỗ, nếu mô hình tăng trưởng theo chiều rộng dựa trên xuất khẩu sản phẩm thô kéo dài liên tục và quá lâu, các nhân tố điều kiện tự nhiên và tài nguyên thiên nhiên sẽ dần mất đi tính sẵn có. Tăng trưởng xuất khẩu nhóm hàng này cũng gây ra nhiều hệ lụy như phá rừng để phát triển trồng sắn, cà phê, hồ tiêu, cao su xuất khẩu; gây ô nhiễm môi trường sông, biển để phát triển thủy sản... như đã được đề cập. Lợi ích tức thời khó bù đắp được những ảnh hưởng tiêu cực trong trung và dài hạn có thể là một nguyên nhân dẫn đến tác động tiêu cực của xuất khẩu hàng thô và sơ chế tới TFP.

Một yếu tố nữa có thể nằm ở ngay trong chính cơ cấu xuất khẩu của nhóm hàng thô và sơ chế. Trở lại với phần lý thuyết và nghiên cứu thực nghiệm trên thế giới, có những mặt hàng thô và sơ chế vẫn có ảnh hưởng động, lan tỏa mạnh

tới nền kinh tế nếu đó là những mặt hàng, theo cách đánh giá của Hausman và cộng sự (2006), Chandra và cộng sự (2007), có chỉ số PRODY (productivity level) cao. Một số mặt hàng như vậy có xu hướng giảm tỷ trọng trong cơ cấu xuất khẩu của Việt Nam những năm gần đây, trong khi xu hướng tăng lại diễn ra với một số mặt hàng có PRODY thấp.

Bảng chỉ số PRODY và tỷ trọng kim ngạch xuất khẩu một số mặt hàng thô và sơ chế

| Mặt hàng | Chỉ số PRODY | Xuất khẩu năm 2000 (%) | Xuất khẩu năm 2011 (%) |
|----------------------------------------------------------------|--------------|------------------------|------------------------|
| Rau tươi, ướp lạnh, ướp đông, rễ, thân củ tươi hoặc đã sấy khô | 5477 | 0,58 | 0,57 |
| Nước rau quả | 5141 | 0,03 | 0,02 |
| Quả đã được bảo quản hay chế biến | 9337 | 0,44 | 0,12 |
| Cà phê | 1936 | 2,63 | 2,95 |
| Cao su tự nhiên | 1169 | 1,10 | 3,10 |

Nguồn: Chỉ số PRODY: Chandra, Boccardo và Osorio (2007). Tỷ trọng kim ngạch xuất khẩu: tác giả tính từ SITC cấp độ 3 chữ số.

Một số nghiên cứu trên thế giới cũng cho kết quả tương tự. Chẳng hạn, nghiên cứu của Richard (2001) với trường hợp Paraguay chứng minh rằng sự bùng nổ xuất khẩu hàng hóa thô và sơ chế không có tác động tích cực tới tăng trưởng kinh tế của đất nước này, hàm ý rằng không phải tất cả sự “bùng nổ” xuất khẩu đều giống nhau về triển vọng thúc đẩy tăng trưởng trong dài hạn. Như vậy, tỷ trọng xuất khẩu hàng hóa thô và sơ chế có tác động ngược chiều tới tăng trưởng kinh tế. Từ năm 2000 đến nay, ở Việt Nam mặc dù sự chuyển dịch cơ cấu diễn ra còn chậm, nhưng tỷ trọng xuất khẩu hàng thô và sơ chế giảm, nghĩa là kinh tế có thể tăng trưởng nhờ sự giảm xuất khẩu hàng thô và sơ chế này. Điều này cho thấy rằng định hướng chuyển dịch cơ cấu hàng xuất khẩu theo hướng giảm dần xuất khẩu sản phẩm thô và sơ chế như đã và đang thực hiện ở Việt Nam là hoàn toàn phù hợp về mặt lý luận và thực tiễn, là xu hướng sẽ có

tác động tích cực tới tăng trưởng kinh tế cả trong ngắn hạn cũng như dài hạn, và cần được thúc đẩy trong thời gian tới.

4.3. Tác động của xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng lao động tới tăng trưởng kinh tế

Sau 1 quý tăng trưởng kinh tế bắt đầu có sự phản ứng trước thay đổi xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng lao động. Hệ số tác động của biến DEX2SA ở các mức trễ X, 6, 7 tương ứng là 0,097, -0,053, -0,074. Như vậy, ban đầu gia tăng xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng lao động có tác động tích cực tới tăng trưởng kinh tế nhưng tác động tích cực này dần bị triệt tiêu và trở nên tiêu cực kể từ quý thứ 6 trở đi khiến cho ảnh hưởng tích lũy (dài hạn) < 0 . Độ trễ càng lớn, tác động tiêu cực càng gia tăng về cường độ thể hiện ở giá trị tuyệt đối của các tham số có xu hướng tăng lên. Ảnh hưởng động không như kỳ vọng này của nhóm hàng chế biến thâm dụng lao động có thể giải thích bằng một số lý do sau:

Thứ nhất, một số ngành thâm dụng lao động đòi hỏi vốn đầu tư khá lớn như sắt thép và sản phẩm từ sắt thép, dệt may, da giày, sản phẩm từ chất dẻo... bị ảnh hưởng tiêu cực của năng suất cận biên của vốn giảm dần. Thêm vào đó, các ngành thâm dụng lao động lại sử dụng công nghệ khá lạc hậu so với thế giới. Tỷ trọng của các sản phẩm công nghệ vừa và cao trong tổng giá trị gia tăng của các mặt hàng chế biến xuất khẩu nói chung chỉ ở mức trên 20% và không thay đổi trong những năm gần đây. Các lĩnh vực công nghệ thấp sử dụng nhiều lao động chiếm tới hơn 70% giá trị gia tăng của ngành công nghiệp chế biến, cao hơn nhiều so với một số nước trong khu vực (trong giai đoạn 2006 - 2010, của Thái Lan là 53%, của Malaysia là 37%, của Ấn Độ là 46%,...).

Thứ hai, khu vực này chủ yếu hấp thu lao động giản đơn, chưa qua đào tạo nên khó có thể kỳ vọng những ảnh hưởng động đáng kể từ các ngành xuất khẩu thâm dụng lao động. Theo kết quả khảo sát của Ngân hàng Thế giới, tại Việt Nam có khoảng 60% lao động tốt nghiệp từ các trường cao đẳng và dạy nghề cần được đào tạo lại sau khi tuyển dụng. Trên thực tế, lợi thế so sánh về lao động của Việt Nam đang có xu hướng giảm dần; hay nói theo cách xác định của học thuyết H-O, lao động dần mất vai trò của nhân tố “rẻ” do giá nhân công đang đắt dần lên một cách tương đối (so với một số nước chi phí tuyệt đối lao động của Việt Nam thấp hơn nhưng chi phí lao động/đơn vị sản phẩm lại cao hơn do năng suất lao động ở Việt Nam vẫn còn khoảng cách xa với các nước

trong khu vực và thế giới). Theo kết quả tính toán của nhiều chuyên gia kinh tế thì hiện nay để tạo ra một chỗ làm việc mới cần đầu tư khoảng 1.000 USD, trong khi đó năng suất lao động tạo ra chỉ đạt 1.023 USD/lao động.

Thứ ba, một số mặt hàng xuất khẩu thâm dụng lao động đã bị tác động bởi xu hướng “commoditized”. Blecker (2010) đã nhận định rằng, rất nhiều hàng hóa chế biến xuất khẩu đã trở nên “commoditized” và có động thái giống như các hàng hóa sơ chế ở khía cạnh dễ bị ảnh hưởng bởi điều kiện thương mại xấu đi khi xuất khẩu tăng lên về lượng (fallacy of composition). Tính chất này thể hiện rõ nhất ở các sản phẩm công nghiệp nhẹ (light manufactures), chính là những mặt hàng xuất khẩu trong nhóm thâm dụng lao động của Việt Nam.

Thứ tư, khai thác xuất khẩu từ nhóm hàng này từ năm 2000 đến nay chủ yếu theo hướng duy trì và mở rộng danh mục, không có sự đầu tư thêm về chất như chuyển sang những công đoạn có giá trị gia tăng cao hơn trong chuỗi giá trị, tăng hàm lượng kỹ năng, công nghệ,... Phân tích sâu hơn về quá trình phát triển xuất khẩu mặt hàng thâm dụng lao động có thể thấy, giai đoạn có sự chuyển biến mạnh mẽ nhất là giai đoạn 1991-1996 như đã được chỉ ra trong phần thực trạng, và vì vậy nhiều khả năng lợi ích cận biên cũng là lớn nhất trong giai đoạn này. Điển hình như trong ngành dệt may, mặc dù là một trong những “trụ cột” xuất khẩu đến nay mới chỉ tham gia chuỗi cung ứng dệt may thế giới ở khâu cắt may, làm hàng gia công, là công đoạn có giá trị gia tăng thấp nhất trong chuỗi giá trị.

4.4. Tác động của xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng kỹ năng tới tăng trưởng kinh tế

Kết quả ước lượng tham số của biến DEX3SA trong phương trình 2 cho thấy, xuất khẩu hàng chế biến thâm dụng kỹ năng có ảnh hưởng tích cực và với cường độ mạnh nhất tới tăng trưởng kinh tế. Điều đó cho thấy rằng, hàng hóa xuất khẩu thâm dụng kỹ năng, những sản phẩm không chỉ là sức lao động đơn thuần mà quan trọng hơn, là kết quả của quá trình đào tạo, là kết tinh của yếu tố vốn con người, đã mang lại năng suất, giá trị gia tăng, có ảnh hưởng lan tỏa đáng kể tới phần còn lại của nền kinh tế.

Kết quả này phù hợp với lý thuyết và thực tiễn. Lao động kỹ năng là kết quả của quá trình đào tạo nên những mặt hàng thâm dụng kỹ năng không chỉ là sản phẩm của sức lao động đơn thuần, mà quan trọng hơn, đó là kết tinh của yếu tố vốn con người. Do đó, hàng hóa xuất khẩu thâm dụng kỹ năng thường mang

lại năng suất, giá trị gia tăng, có ảnh hưởng lan tỏa lớn hơn hàng hóa thâm dụng lao động. Mayer và Wood (2001) đã chỉ ra sự khác biệt rất lớn về tỷ trọng xuất khẩu hàng hóa thâm dụng kỹ năng trong tổng kim ngạch xuất khẩu (31,2% với 0,9%) là một trong những nguyên nhân dẫn đến sự đối lập giữa sự chậm phát triển, nghèo đói của các nước Nam Á với sự phát triển mạnh mẽ của các nước Đông Á. Ngoài ra, một số mặt hàng thâm dụng kỹ năng đồng thời cũng là những mặt hàng thâm dụng vốn, có mức độ phức tạp và hàm lượng công nghệ cao tương đối trong cơ cấu hàng hóa xuất khẩu. Theo báo cáo của UNIDO (2012), mặc dù có hiệu ứng lan tỏa hạn chế với các doanh nghiệp trong nước nói chung, các doanh nghiệp FDI ở Việt Nam vẫn có tác động đến năng suất lao động của các doanh nghiệp nội địa nếu các doanh nghiệp thâm dụng kỹ năng và thâm dụng vốn Jim Lee (2010), từ kết quả nghiên cứu 71 nước xuất khẩu, cũng chỉ ra rằng những nước gia tăng chuyên môn hóa xuất khẩu mặt hàng có hàm lượng công nghệ cao đạt được sự tăng trưởng nhanh hơn đáng kể so với những nước chuyên môn hóa xuất khẩu những mặt hàng truyền thống hoặc có hàm lượng công nghệ thấp như dệt may, thực phẩm. Những nước mới nổi như Trung Quốc tăng trưởng nhanh chóng không chỉ bởi mở cửa nhiều hơn mà còn do những nước này ngày càng có sức cạnh tranh hơn trong việc xuất khẩu các hàng hoá công nghệ cao.

4.5. Tác động của đa dạng hóa hàng xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế

Ảnh hưởng của chuyên môn hóa/đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế được thể hiện qua tham số của các biến DHISA, DTSA, DTWSA và DTBSA trong các phương trình ước lượng. Theo đó, trong ngắn hạn, gia tăng chuyên môn hóa có thể tác động tích cực, nhưng về dài hạn, đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu mang lại nhiều hiệu ứng tích cực hơn tới tăng trưởng kinh tế.

Kết quả này phù hợp với lập luận và bằng chứng thực nghiệm về quan hệ phi tuyến (dạng chữ U) giữa đa dạng hóa xuất khẩu với tăng trưởng kinh tế đã được đưa ra bởi Imbs và Wacziarg (2003). Đối chiếu với quy luật thực nghiệm này, Việt Nam mới chỉ bắt đầu chuyển sang nhóm nước có mức thu nhập trung bình kể từ năm 2010, nên đa dạng hóa mới là xu hướng thực sự có hiệu ứng tích cực hơn tới tăng trưởng kinh tế. Đa dạng hóa giúp ổn định thu nhập từ xuất khẩu, mở rộng phạm vi và giá trị gia tăng của hàng hóa, tạo tiền đề cần thiết cho quá trình tái tập trung vào những mặt hàng có lợi thế so sánh động, có lợi thế so

sánh bậc cao và có ảnh hưởng lan tỏa mạnh hơn đến nền kinh tế ở giai đoạn sau, khi thu nhập bình quân đầu người vượt qua “điểm ngoặt” để đạt được mức cao hơn.

Như vậy, trong ngắn hạn, gia tăng chuyên môn hóa trên cơ sở lợi thế so sánh vẫn có thể tác động tích cực tới gia tăng tăng trưởng kinh tế. Tuy nhiên, do tính chất khai thác hiện nay chủ yếu dựa trên các lợi thế bậc thấp, lợi thế so sánh tĩnh về tài nguyên, lao động giá rẻ nên việc tiếp tục khai thác quá mức không bù đắp được những chi phí và hệ quả tiêu cực đối với môi trường và các nguồn lực khác. Trong dài hạn, đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu mang lại nhiều hiệu ứng tích cực hơn tới tăng trưởng kinh tế.

Trong hai xu hướng đa dạng hóa mặt hàng xuất khẩu thì đa dạng hóa theo chiều rộng có tác động tích cực tới tăng trưởng kinh tế trong dài hạn, nhưng chưa thấy bằng chứng rõ ràng (tham số của DTBSA=0) tác động của đa dạng hóa theo chiều sâu tới tăng trưởng kinh tế về lý thuyết, cả hai xu hướng đa dạng hóa theo chiều rộng và đa dạng hóa theo chiều sâu đều có thể có hiệu ứng tích cực đối với tăng trưởng kinh tế. Tuy nhiên, vận dụng vào thực tế thì còn phải dựa vào đặc trưng giỏ hàng hóa xuất khẩu của từng quốc gia để xem xét và đánh giá, vì cơ cấu hàng hóa có thể tương đồng về mặt thống kê nhưng có thể rất khác nhau, xét ở tác động tới tăng trưởng kinh tế.

Kết quả phân tích phản ánh thực tế rằng, đa dạng hóa theo chiều rộng đã góp phần mở rộng các ngành, lĩnh vực hiện có, kích thích phát triển các ngành nghề mới, lĩnh vực sản xuất mới, các mối quan hệ liên kết trong nền kinh tế, có ảnh hưởng lan tỏa động và tích cực tới toàn bộ nền kinh tế. Trong khi đó, quá trình đa dạng hóa mặt hàng theo chiều sâu chưa mang lại lợi ích như kỳ vọng. Thực tế, trong giỏ hàng hóa xuất khẩu của Việt Nam kể từ năm 2000 đến nay, tỷ trọng hàng chế biến thâm dụng lao động chiếm tới hơn 70%, nhóm hàng chế biến thâm dụng kỹ năng chỉ thực sự chiếm tỷ trọng lớn từ năm 2012. Như vậy, đa dạng hóa theo chiều sâu chủ yếu diễn ra theo hướng dịch chuyển nguồn lực từ nhóm hàng thô và sơ chế sang nhóm hàng chế biến thâm dụng lao động, là nhóm hàng mà, kết hợp với phân tích ở trên, gia tăng xuất khẩu thậm chí có ảnh hưởng tiêu cực tới tăng trưởng kinh tế nhiều hơn nhóm hàng thô và sơ chế. Vì vậy, quá trình đa dạng hóa theo chiều sâu chưa thực sự diễn ra đúng nghĩa, chưa đủ độ “sâu” cần thiết nên hiệu ứng động đối với nền kinh tế còn hạn chế. Kết

quả này tương tự với nghiên cứu của Ferreira (2009) với Costa Rica, Lim và Saborowski (2011) cho trường hợp Xyri. Đa dạng hóa sang các sản phẩm năng suất thấp, hoặc quá trình đa dạng hóa chưa tạo ra năng lực sản xuất mới trong các khu vực khác của nền kinh tế thông qua lan tỏa kiến thức là nguyên nhân dẫn đến kết quả như mong đợi ở hai nước kể trên, phần nào cho thấy đa dạng hóa sản phẩm xuất khẩu, ngoài tầm quan trọng hơn nhất là các sản phẩm “mới”, sản phẩm cần bảo đảm những mức độ biến động ít hơn, ảnh hưởng lan tỏa nhiều hơn và có vị trí cao hơn trên “phổ chất lượng”.

4.6. Ảnh hưởng của việc gia nhập WTO đến tác động của xuất khẩu tới tăng trưởng kinh tế

Kết quả ước lượng chưa cho thấy bằng chứng rõ ràng về tác động khác biệt của xuất khẩu hàng hóa tới tăng trưởng kinh tế trước và từ khi Việt Nam gia nhập WTO.

Tác động chưa như kỳ vọng này có thể giải thích bằng những lý do khách quan và chủ quan, về khách quan, ngay sau khi Việt Nam gia nhập WTO đầu năm 2007 thì cuối năm đó, kinh tế toàn cầu đã biến động phức tạp. Cuối năm 2008, khủng hoảng tài chính Mỹ bùng nổ kéo theo nền kinh tế toàn cầu rơi vào suy thoái trầm trọng, gây ra những hệ lụy không nhỏ với nền kinh tế còn ở “level” thấp như Việt Nam. Tuy nhiên, những nguyên nhân chủ quan đóng vai trò quyết định. Đó là: (i) Khả năng chủ động nắm bắt những cơ hội từ hội nhập còn hạn chế; (ii) Những hạn chế nội tại của xuất khẩu hàng hóa Việt Nam như năng suất, chất lượng thấp, chi phí cao, năng lực hấp thu công nghệ chưa được cải thiện đáng kể... Xuất khẩu tăng nhanh về lượng nhưng tốc độ tăng trưởng xuất khẩu bình quân lại thấp hơn so với giai đoạn trước, lại chủ yếu phụ thuộc vào doanh nghiệp FDI nên thiếu bền vững nếu một lúc nào đó luồng vốn này chuyển dịch sang các nước khác. Xuất khẩu hàng hóa vẫn phụ thuộc vào nhập khẩu trung gian từ Trung Quốc, công nghệ cao chưa có gì mới, trong ngành dệt may vẫn là “đạp máy khâu” và “nồi mối hàn” trong ngành đóng tàu.

Một số nghiên cứu gần đây về tác động của WTO tới kinh tế Việt Nam cũng đồng quan điểm này. Chẳng hạn, theo báo cáo “Đánh giá tổng thể tình hình kinh tế - xã hội Việt Nam sau 5 năm gia nhập WTO” của CIEM thì sau khi hội nhập WTO, chất lượng tăng trưởng kinh tế của Việt Nam kém hơn giai đoạn trước thể hiện ở hiệu quả tăng trưởng kinh tế suy giảm, tăng trưởng chủ yếu dựa

vào vốn, năng suất lao động thấp, đóng góp của TFP chỉ chiếm 0,4% so với 2,6% bình quân hằng năm giai đoạn trước. Việt Nam trở thành nền kinh tế dễ bị tổn thương vì các cú sốc cả bên ngoài lẫn bên trong. So sánh giữa nhóm tác động tích cực và tiêu cực thì nhóm tiêu cực có ảnh hưởng lớn hơn.



TTBD ĐBDC

