

SỰ BIẾN ĐỘNG GIÁ VÀ KHẢ NĂNG CẠNH TRANH CỦA CÀ PHÊ VIỆT NAM XUẤT KHẨU TRÊN THỊ TRƯỜNG THẾ GIỚI

Tô Thị Kim Hồng

Trường Đại học Mở TP.HCM

tothikimhong@gmail.com

Ngày nhận bài: 17/7/2016; Ngày duyệt đăng: 30/7/2016

TÓM TẮT

Việc phân tích sự biến động giá các mặt hàng nông sản xuất khẩu là công việc cần thiết nhằm giúp cho quốc gia có thể dự đoán trước những sự biến động và từ đó có thể có phương án dự phòng rủi ro. Nghiên cứu này sử dụng phương pháp định tính và phương định lượng để đánh giá những yếu tố chính ảnh hưởng đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam. Giá cà phê Việt Nam vận động theo cùng xu hướng với giá cà phê trên thị trường quốc tế, xu hướng này càng trở nên rõ nét hơn khi Việt Nam trở thành một trong những nước dẫn đầu thế giới về sản xuất và xuất khẩu cà phê Robusta. Qua quan sát và phân tích 34 năm biến động của giá cà phê, cho thấy giá cà phê biến động có tính chu kỳ tăng 5 năm và chu kỳ giảm 7 năm. Kết quả phân tích mô hình logarit kép có thể thấy giá xuất khẩu của Brazil có vai trò rất lớn trong việc dự báo giá xuất khẩu cà phê của Việt nam. Khi giá cà phê Brazil tăng 1%, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam có xu hướng tăng 0,31%.

Từ khóa: cà phê Việt Nam.

ABSTRACT

The volatility and competitiveness of Vietnam coffee export on world market

The analysis of fluctuation in price of exported agricultural products helps policy makers and producers predict future changes in the price and then suggest some solutions for risk mitigation. This study employed qualitative and quantitative methods to measure effects of some major factors on price of Vietnamese coffee. The findings showed that Vietnamese coffee price fluctuated with the trends of the world price. With observations of price fluctuation of Vietnamese coffee over 34 year, the price seemed to be in cycles of 5 year increase and 7 year decrease. The regression results showed that the Brazillian coffee price seemed to have an important effect on Vietnamese exported coffee price as the latter was estimated to increase by 0.31% with an 1% increase in the former price.

Keywords: Vietnamese coffee.

1. Đặt vấn đề

Thông qua xuất khẩu nông sản, Việt nam đã mở rộng thương mại đa phương, giảm phụ thuộc vào một số ít thị trường như trước đây và nâng cao vị thế quốc gia trên thị trường thế giới. Trị giá xuất khẩu nông sản của Việt Nam đã đạt hơn 20 tỷ đô la (năm 2014), chiếm 14% trong tổng giá trị xuất khẩu của tất cả các mặt hàng ngoại trừ xăng dầu và khoáng sản. Trong đó ba mặt hàng có giá trị xuất khẩu đứng đầu là thủy sản, cà phê và gạo (Tổng cục Thống kê, 2015). Giá trị xuất khẩu này mang lại khối lượng ngoại tệ đáng kể cho đất nước nhưng luôn bị ảnh hưởng và phụ thuộc vào sự biến động của giá thị trường thế giới, đặc biệt trong thời kỳ hội nhập quốc tế như hiện nay. Kết quả là dù có công đóng góp rất lớn cho nền kinh tế nước nhà, nông dân vẫn phải đối mặt với cuộc sống không ổn định khi giá cả biến động thường xuyên, còn doanh nghiệp thì đứng trước nhiều rủi ro trong hoạt động kinh doanh.

Trong năm 2001, ngành cà phê đã gây hồi chuông báo động cho cộng đồng quốc tế khi có sự kiện 14 người Mehico trẻ tuổi bị chết khi cố gắng di cư vào Mỹ để tìm việc được cho là liên quan đến giá cà phê thế giới bị giảm (Greenfield, 2002). Hay trường hợp của Ấn Độ khi tự do hóa thương mại, xuất khẩu lúa mì tăng, nhưng nhập khẩu giảm đã làm giá trong nước tăng (Sekhar, 2003). Trong khi đó, ở Việt Nam, giá cao su và cà phê giảm trong hai năm gần đây khiến cuộc sống người dân trong khu vực sản xuất bị đảo lộn khiến nhiều nông dân nhỏ lẻ phải ngưng sản xuất.

Giá cả giữ vai trò trung tâm trong các lý thuyết kinh tế, hình thành và bị tác động bởi các yếu tố sản xuất và tiêu dùng. So với hầu hết sản phẩm phi nông nghiệp và dịch vụ, giá sản phẩm nông nghiệp biến động nhiều hơn (Tomex and Robinson, 2003). Xem xét ở góc độ khác giá mặt hàng nông sản biến động mạnh và thiếu

ổn định, nguyên nhân phần lớn nông sản là mặt hàng thiết yếu (lúa, ngô, sắn,...) nên chi tiêu về hàng nông sản chiếm một tỷ trọng ít trong thu nhập. Do đó, cầu về nông sản thường kém co giãn trong khi cung co giãn rất nhiều do ảnh hưởng bởi thời tiết, mùa vụ, chỉ cần một thay đổi nhỏ trong cung đã làm giá biến động (Hồ Thị Hoàng Lương, 2013). Theo nhiều nhà kinh tế học rất khó dự đoán được giá nông sản trong ngắn hạn. Do đó, phân tích biến động giá nông sản luôn là mối quan tâm của các nhà kinh tế ở nhiều quốc gia, đặc biệt là những quốc gia xuất khẩu nông sản như Việt Nam; nguyên nhân hay những yếu tố ảnh hưởng đến giá mặt hàng nông sản xuất khẩu và quốc gia nào ảnh hưởng mạnh nhất đến Việt Nam cũng là vấn đề quan trọng trong phân tích.

Bài viết này phân tích sự biến động của giá cả phê xuất khẩu của Việt nam khi Việt Nam đang hội nhập sâu hơn vào thị trường quốc tế đồng thời so sánh bản chất cạnh tranh của cả phê Việt Nam so với các quốc gia khác khi xuất khẩu trên thị trường thế giới. Ngoài ra, với mô hình hồi qui tuyến tính, đề tài cũng đo lường sự tác động của một số yếu tố đến giá cả phê xuất khẩu của Việt Nam.

Từ những kết quả khám phá này sẽ cung cấp thông tin cho các nhà sản xuất, kinh doanh nhằm giúp cho các nhà quản lý có thể nắm bắt được tình hình xuất khẩu, những biến động trong tương lai từ đó có cơ sở hoạch định các chính sách phù hợp. Các doanh nghiệp Việt Nam cũng có thể dựa trên kết quả nghiên cứu để đưa ra những giải pháp phòng ngừa rủi ro trong hoạt động xuất khẩu cũng như giúp nâng cao năng lực cạnh tranh của nông sản Việt Nam trên thị trường thế giới.

2. Cơ sở lý thuyết và phương pháp nghiên cứu

2.1. Hiệu ứng giá và hiệu ứng lượng

Hiệu ứng giá và lượng trong tăng trưởng giá trị xuất khẩu là một bài toán dựa trên công thức (Trung tâm Nghiên cứu phát triển, Trường Đại học Mở TP.HCM)

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

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. Khung cơ sở lý thuyết hình thành giá

Theo Goodwin và Holt (1999), giá là một cơ chế cơ bản thể hiện mối liên hệ của các thị trường. Mối liên hệ giữa lượng cầu và giá luôn có mối liên hệ mật thiết và sự biến động giá ở thị trường này sẽ tác động đến giá cân bằng ở thị trường khác (Engle và Quagrainie, 2009). Căn cứ trên trạng thái cân bằng khi lượng cung bằng lượng cầu đối với thị trường thế giới, mô hình giá được thiết lập làm nền tảng cho việc đề xuất một mô hình thực nghiệm cho kinh tế lượng

Theo lý thuyết kinh tế học, hàm cung xuất khẩu của cả phê Việt Nam có thể được thể hiện qua hàm số tổng quát sau :

$$Q_s = f(P_x, E_x, P_{oil}) \quad (\text{Mô hình 1})$$

Với Q_s : Lượng cả phê xuất khẩu

P_x : Giá cả phê xuất khẩu

E_x : tỷ giá hối đoái (VND/USD)

P_{oil} : Giá dầu thế giới (đại diện cho các yếu tố tác động đến cung xuất khẩu, ngoài giá)

Trong khi đó, hàm cầu xuất khẩu của cả phê Việt Nam được thể hiện tổng quát như sau

$$Q_d = f(P_x, I, P_R, P_j) \quad (\text{Mô hình 2})$$

Với Q_d : Lượng cầu cả phê xuất khẩu

P_x : Giá cả phê xuất khẩu

I: thu nhập của người tiêu dùng;

P_R : giá của hàng hóa liên quan

P_j : giá của các quốc gia xuất khẩu cả phê cạnh tranh với Việt nam trên thế giới

Với giả định $Q_d = Q_s$, từ các hàm số tổng quát (Mô hình 2) trên, ta có thể suy ra mô hình thực nghiệm về giá cả phê xuất khẩu cho nghiên cứu như sau:

$$P_X = a + bI + c_j \sum_{j=1}^n P_j + dEX + eP_R + gP_{oil}$$

(Mô hình 3)

2.1.3. Lý thuyết về cạnh tranh

Đối với thị trường cạnh tranh hoàn toàn hay không hoàn toàn, cân bằng dài hạn xảy ra khi lợi nhuận giảm xuống bằng không. Theo Ymkella, Unnevehr và Garcia (1994) thị trường nông sản xuất khẩu thường là thị trường cạnh tranh không hoàn hảo. Kết luận này cũng tương tự cho mặt hàng sữa đậu nành xuất khẩu (Deodhar và Sheldon, 1997).

Trong thị trường cạnh tranh không hoàn hảo, một hãng định giá hoặc sản lượng của mình dựa một phần vào các cân nhắc chiến lược liên quan đến hành vi của các đối thủ cạnh tranh của mình. Đồng thời các quyết định của các đối thủ cũng phụ thuộc vào quyết định của hãng.

Mô hình Cournot

Bắt đầu bằng một mô hình đơn giản về độc quyền hai hãng (lường độc quyền) – hai hãng cạnh tranh với nhau – giả sử hai hãng này sản xuất sản phẩm đồng nhất và biết đường cầu thị trường. Mỗi hãng phải quyết định sản xuất bao nhiêu và hai hãng ra quyết định của mình cùng một lúc. Khi ra quyết định sản xuất của mình mỗi hãng đều tính đến các đối thủ cạnh tranh (Pindyck and Rubinfeld, 1999).

Mô hình Stackelberg (Lợi thế của người đi đầu)

Giả định hai nhà độc quyền hai hãng quyết định sản lượng của mình cùng một lúc và một hãng A có thể đặt trước sản lượng của mình. Đối thủ của A làm gì cũng không thành vấn đề, sản lượng của A sẽ cao hơn. Để tối đa hóa lợi nhuận, đối thủ của A phải xem sản lượng cao của A là đã cho và đặt mức sản lượng thấp (nếu đối thủ của A cho mức sản lượng lớn thì điều đó sẽ đẩy giá xuống và cả hai đều thiệt hại).

Mô hình Bertrand (Mô hình cạnh tranh giá)

Mô hình Cournot và Stackelberg là 2 mô hình khác nhau về hành vi cạnh tranh không hoàn toàn dựa trên cạnh tranh về lượng cung ứng ra thị trường. Trong nhiều ngành, cạnh tranh độc quyền xảy ra theo khía cạnh giá. Giả sử hai nhà độc quyền hai hãng này cạnh tranh bằng cách định giá cùng một lúc thay vì đặt sản lượng. Các hãng sản xuất sản phẩm đồng nhất, nên người tiêu dùng sẽ chỉ mua từ người bán giá thấp hơn. Vì thế nếu hai hãng định giá khác nhau thì hãng định giá

thấp sẽ cung ứng toàn bộ thị trường. Trước đây, 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. Tuy nhiên, nghiên cứu của Hackner (2000) cho rằng không có chứng cứ nào cho thấy cạnh tranh về lượng hiệu quả hơn cạnh tranh về giá và các nghiên cứu của Carlton và Perloff (2000) và Singh and Vives (1984) đều đánh giá cao cạnh tranh về giá hơn cạnh tranh về lượng. Vives (1985) cũng khẳng định cạnh tranh về giá hiệu quả hơn cạnh tranh về lượng.

Với mô hình cạnh tranh bằng giá, hàm phản ứng giá tổng quát được biểu diễn như sau

$$P_A = f(P_B, Z) \quad (\text{Mô hình 4})$$

Với P_A là giá xuất khẩu của quốc gia A, P_B là giá xuất khẩu của quốc gia B trong khi Z là các yếu tố khác tác động đến giá của quốc gia A.

Mô hình 4 cũng có dạng tương tự Mô hình 3. Do đó, Mô hình 3 được sử dụng cho nghiên cứu này và phù hợp cho bất kỳ giả định nào về thị trường: cạnh tranh hoàn hảo hay không hoàn hảo.

2.2. Phương pháp nghiên cứu

2.2.1. Đối tượng và phạm vi nghiên cứu

Nghiên cứu tập trung phân tích chính về giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam trong 34 năm từ năm 1980 – 2014. Ngoài ra khả năng cạnh tranh của mặt hàng cà phê Việt nam trên thị trường thế giới cũng được đề cập.

2.2.2. Dữ liệu và nguồn dữ liệu

Trong khi dữ liệu sơ cấp được thu thập trong quá trình phỏng vấn chuyên gia, các dữ liệu thứ cấp về giá và các biến số khác được sử dụng để xây dựng mô hình thực nghiệm. Dữ liệu thứ cấp là dữ liệu định lượng theo chuỗi thời gian được thu thập từ UN-Comtrade, IMF, Tổng cục Hải quan, trang tin thương mại Bộ Nông nghiệp và Phát triển nông thôn, FAO, ICO. Giá xuất khẩu là giá FOB được quy đổi ra đô la Mỹ, không bao gồm thuế xuất khẩu (Tổng cục Thống kê, 2011).

Số lượng chuyên gia được phỏng vấn và tham khảo ý kiến là 30 người. Trong đó 35% chuyên gia hiện đang làm cho cơ quan Nhà nước, thực thi pháp luật và tư vấn cho Chính phủ về vấn đề xuất - nhập khẩu của mặt hàng nông sản, đặc biệt là hai mặt hàng chủ lực của nước ta: gạo và cà phê; 35% chuyên gia hiện là những nhà quản lý ở các doanh nghiệp, công ty chuyên về lĩnh vực xuất khẩu nông sản; 20% chuyên gia là

các giảng viên đang công tác tại các Trường Đại học, Viện nghiên cứu có các công trình nghiên cứu khoa học hay về nông sản và 10% chuyên gia đang làm việc tại các Hiệp hội, Liên hiệp thuộc về Nông nghiệp – Nông thôn tại TP.HCM với nhiều năm kinh nghiệm.

2.2.3. Phương pháp phân tích

Bài viết sử dụng phương pháp phân tích tổng hợp; phương pháp tính hiệu ứng giá và lượng để so sánh về bản chất cạnh tranh trong xuất khẩu giữa các quốc gia; phương pháp phỏng vấn chuyên gia bao gồm ba kỹ thuật phỏng vấn: phỏng vấn không cấu trúc, phỏng vấn cấu trúc và phỏng vấn bán cấu trúc (semi-structure interview). Phương pháp định lượng được áp dụng theo phương pháp bình phương tối thiểu (OLS) để xây dựng mô hình hồi qui với công cụ phân tích dữ liệu là phần mềm Eview, version 8.0.

3. Kết quả nghiên cứu

3.1. Sự biến động giá của cà phê thế giới và Việt Nam

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 sụt 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).

Bắt đầu từ năm 1980, giá cà phê trên thị trường thế giới có xu hướng tăng dần với những mức giá cao và lên đến mức đỉnh điểm trong lịch sử ngành cà phê thế giới vào năm 1986. Do bị ảnh hưởng bởi giá cả trên thị trường thế giới mà giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam, Brazil, Ấn Độ và Colombia cũng vận động theo xu hướng tương tự như vậy trong thời gian này. Vào năm 1986, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam, Brazil, Colombia và Ấn Độ đều chạm tới những mức giá cao nhất trong lịch sử ngành cà phê của cả bốn nước lần lượt là 104.23 USD/ tấn ở Việt Nam, 141.21 USD/ tấn ở Brazil, 173.24 USD/ tấn ở Colombia và 107.42 USD/ tấn ở Ấn Độ. Nhưng theo sau cú tăng đột biến này là những đợt sụt dốc liên tiếp của giá cà phê thế giới. Vì sau năm 1989, Hiệp hội Cà phê thế giới (ICA) sụp đổ. Trong khi, trước đây giá cà phê thế giới bị kiểm soát bởi Hiệp hội Cà phê thế giới (ICA). Hiệp hội này đóng vai trò quan trọng trong việc kiểm soát giá cả giữa những nước sản xuất cà phê lớn trên thị trường thế giới và các nước tiêu thụ. Nhờ vậy, giá cà phê thế giới đã khá ổn định và cao trước năm 1989. Khi ICA sụp đổ, giá cả

phê trên thị trường thế giới, cũng như giá xuất khẩu của Việt Nam, Brazil, Ấn Độ và Colombia sụt dốc trong thời gian này (Julie Craves, 2006).

Giá cà phê trên thị trường thế giới đã không hề có một dấu hiệu phục hồi cho đến năm 1993. Tuy giá cả phê hạ xuống thấp, nhưng Hội đồng Cà phê quốc tế (ICC) lại cho rằng giá cà phê thế giới đã rất ổn định từ 1990 đến năm 1993. Kể từ năm 1994 trở đi, theo như Tổ chức Cà phê quốc tế (ICO) mô tả, giá cà phê thế giới trên thị trường tự do giai đoạn này vô cùng biến động. Năm 1994 đến năm 1995, giá cà phê trên thị trường thế giới đã trải qua một đợt tăng giá rất mạnh, cao hơn gấp hai lần so với những năm trước. Trong đó giá cà phê xuất khẩu của bốn nước Việt Nam, Colombia, Brazil và Ấn Độ vào năm 1995 tăng bình quân 2,15 lần so với năm 1993 và 1,05 lần so với mười năm trước. Sau khi có dấu hiệu hạ nhiệt vào năm 1996, chỉ số biến động của giá cà phê thế giới đã tăng lên vào năm 1997 nhưng ở mức độ thấp hơn vào thời điểm 1994 – 1995 (ICC, 2009). Kể từ năm 1998, giá cà phê thế giới đột ngột giảm mạnh. Mức giá cà phê trung bình trên thị trường thế giới được tổng hợp từ Tổ chức Cà phê quốc tế (ICO) đã giảm 20% vào năm 1999, giảm 25% vào năm 2000 và 29% vào năm 2001 (FAO, 2002).

Lượng cung vượt quá cầu, khiến cho giá cà phê trên thế giới và giá cà phê xuất khẩu của bốn nước Việt Nam, Brazil, Colombia và Ấn Độ đồng loạt sụt dốc mạnh và rớt xuống những mức giá thấp nhất trong lịch sử ngành cà phê thế giới (FAO, 2002). Theo số liệu từ UN-Comtrade, vào năm 2002, giá cà phê của Brazil, Colombia, Ấn Độ lần lượt là 25,45 USD/ tấn, 52,57 USD/ tấn, 30,84 USD/ tấn cũng là mức giá thấp nhất trong suốt quá trình nghiên cứu từ năm 1981 đến 2014. Tuy nhiên, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam, Brazil và Ấn Độ đã tăng trung bình gấp 1,3 lần vào năm 2003 theo xu hướng trên thị trường thế giới, riêng giá cà phê xuất khẩu của Colombia vẫn chưa hồi phục sau cuộc khủng hoảng cà phê năm 2000. Năm 2004 được xem là năm đầu tiên thị trường cà phê thế giới có dấu hiệu thoát khỏi cuộc khủng hoảng kéo dài hơn bốn năm qua.

Kể từ năm 2004 đến năm 2014, giá cà phê trên thị trường thế giới có khuynh hướng tăng đều qua các năm. Giá cà phê thế giới ít biến động hơn. Chỉ duy nhất ở ba năm 2009, 2012 và 2013, giá cà phê trên thị trường thế giới bị rớt giá mạnh. Vào năm 2014, giá cà phê xuất khẩu của

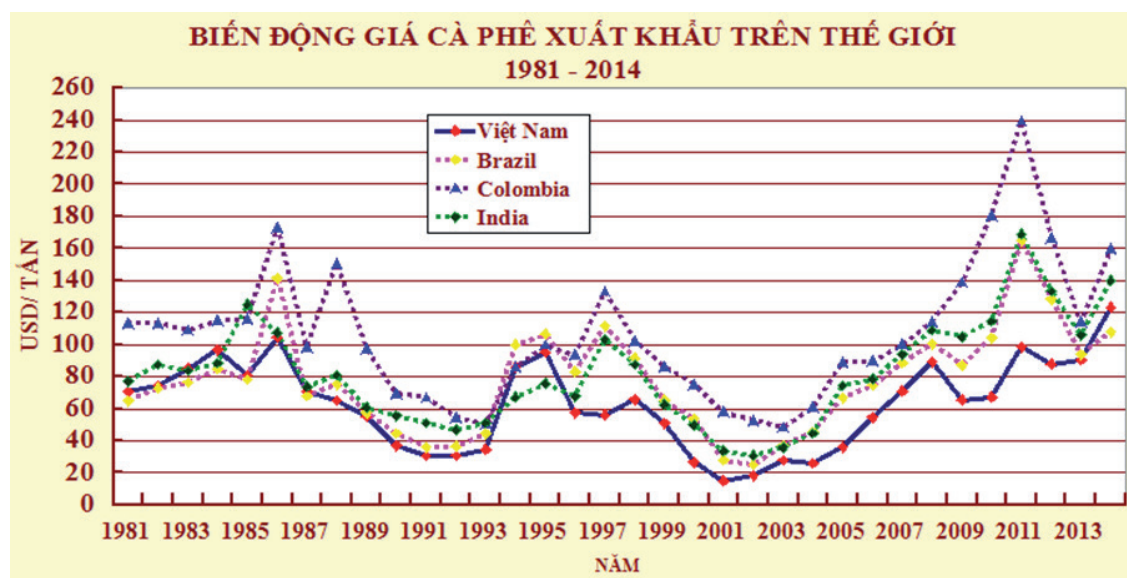
Việt Nam, Brazil, Ấn Độ chạm tới những mức giá cao nhất từ năm 1981 đến nay. Cụ thể, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam năm 2014 là 123,22 USD/ tấn, cao hơn gấp 1,37 lần so với năm trước và 4,74 lần so với mười năm trước. Giá cà phê xuất khẩu của Brazil năm 2014 là 107,895 USD/ tấn, cao hơn gấp 1,15 lần so với năm trước và 2,36 lần so với mười năm trước. Trong khi, giá cà phê xuất khẩu của Ấn Độ năm 2014 là 140,14 USD/ tấn, cao hơn gấp 1,32 lần so với năm trước và 3,145 lần so với mười năm trước. Tuy giá cà phê xuất khẩu của Colombia cũng chạm tới mức giá khá cao là 159,71 USD/ tấn ở năm 2014 nhưng mức giá cao nhất mà nước này đạt được là 166,69 USD/ tấn vào năm 2012.

Nhận xét:

Nhìn chung, giá cà phê Việt Nam vận động theo cùng xu hướng với giá cà phê trên thị trường quốc tế, xu hướng này càng trở nên rõ nét hơn khi Việt Nam trở thành một trong những nước dẫn đầu thế giới về sản xuất và xuất khẩu cà phê Robusta, đặc biệt là sau chính sách tự do hóa thị trường cà phê xuất khẩu từ những năm đầu thập niên 90. Những biến động lớn từ tình hình cà phê quốc tế luôn lập tức gây những ảnh hưởng nhất định đến thị trường cà phê trong nước. Việc mở rộng quá nhanh diện tích trồng cà phê và sự tăng lên nhanh chóng lượng cà phê xuất khẩu của nước ta đã có gây ra tác động lớn đến thị trường cà phê thế giới. Kết quả là giá cà phê xuất khẩu và sự dao động giá cà phê ở thị trường trong nước chịu ảnh hưởng ngày càng

lớn bởi tình hình biến động của thị trường cà phê quốc tế.

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 1981 đến năm 2014, 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 trong năm 1997 và 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 chỉ thị của Tổ chức Cà phê quốc tế (ICO) khoảng 25% (Đoàn Triệu Nhận, 2009). Nguyên nhân giá xuất khẩu cà phê Việt Nam thường thấp hơn so với thế giới là do chất lượng cà phê nước ta chưa cao; cà phê nước ta



Hình 1: Biến động giá cà phê xuất khẩu của các quốc gia có sản lượng cà phê xuất khẩu đứng đầu thế giới từ năm 1981 đến năm 2014

chưa có thương hiệu; khả năng đàm phán và tiếp thị sản phẩm của các doanh nghiệp xuất khẩu cà phê còn thấp; Việt Nam thường xuất khẩu cà phê nhân theo giá FOB do có ít điều kiện thuê tàu và không có kinh nghiệm buôn bán theo giá CIF.

3.2. Kết quả hồi qui của mô hình giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam

Với mô hình thực nghiệm xuất phát từ quy luật cung - cầu

$$P_X = a + bI + c_j \sum_{j=1}^n P_j + dEX + eP_R + gP_{oil}$$

Ta có thể sử dụng hàm số trên dưới dạng mô hình First difference double-log như sau

$$+ \alpha_3 LnE_X + \alpha_4 LnP_R + \alpha_5 LnP_{oil}$$

$$+ \alpha_3 LnE_X + \alpha_4 LnP_R + \alpha_5 LnP_{oil}$$

Do giá nông sản luôn biến động theo mùa, các biến giả Q_i ($i=1,2,3$), đại diện cho 3 quý đầu trong năm, được bổ sung vào mô hình để xác định các yếu tố mùa vụ đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam; Quý 4 được xem là biến cơ sở cho các biến giả Q_i , nên không được đưa vào mô hình hồi qui. Với phần mềm Eview 8.0, kết quả mô hình sau khi được hiệu chỉnh như sau:

$$DLNP_{Xt} = -0,01*** + 0,35DLNEX_t + 0,45***DLN_{oil}_t + 0,31***DLN_{Brazil}_t - 0,02DLN_{Columbia}_t + 0,01DLN_{tea}_t + 0,03***Q1t + 0,03***Q2t + 0,01Q3t + et$$

Với $R^2 = 0,31$; $D.W=2,01$; P_{Xt} là giá cà phê VN xuất khẩu; P_{Brazil} , $P_{Columbia}$ lần lượt là giá cà phê xuất khẩu của Brazil và Columbia trên thị trường thế giới và P_{tea} là giá trà xuất khẩu trên thế giới. Ngoài ra mô hình cũng cho phép xác định tác động của tỷ giá (EX).

Kết quả hồi qui cho thấy giá cà phê xuất khẩu của Brazil và Colombia đều có ảnh hưởng đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam. Tuy nhiên, chỉ có giá cà phê Brazil có tác động có ý nghĩa đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam. Khi giá cà phê Brazil tăng 1%, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam có xu hướng tăng 0,31%. Trong khi giá trà thế giới ảnh hưởng không đáng kể (không có ý nghĩa thống kê), tác động của giá nhiên liệu (P_{oil}) đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam là có ý nghĩa thống kê ($P<0,001$). Khi giá dầu thế giới tăng 10%, giá cà phê xuất khẩu Việt Nam được dự đoán tăng 4,5%. Với kết quả hồi qui như trên, giá cà phê xuất khẩu Việt Nam được dự đoán tăng có ý nghĩa thống kê trong khi tăng không có ý nghĩa trong quý 3 so với quý 4.

3.3. Khả năng cạnh tranh của cà phê Việt Nam trên thị trường thế giới

Ngoài ra, việc xuất khẩu cũng mang lại ngoại tệ nhiều hơn vào thời điểm đầu năm hay nói cách khác tại các tháng khác nhau trong một năm cũng có ảnh hưởng đến giá xuất khẩu, giá xuất khẩu từ tháng 1 đến tháng 6 cao hơn các tháng cuối năm. Vào quý 2 thường niên là vào vụ thu hoạch của Brazil, cà phê Việt Nam và Colombia thường thu hoạch trong quý 4. Như vậy trong thời điểm Brazil thu hoạch cà phê, giá cà phê Việt Nam đang cao điều này cũng góp phần lý giải tại sao việc xuất khẩu của Brazil thuận lợi. Trường hợp của Việt Nam thì ngược lại, khi vào vụ thu hoạch giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam thấp nhất trong năm theo ý kiến chuyên gia điều này thường xảy ra vì lợi ích cá nhân các doanh nghiệp tranh nhau mua và bán dẫn đến việc rớt giá. Việc rớt giá này không làm nâng cao khả năng cạnh tranh của Việt Nam trên thị trường thế giới khi giá thành sản xuất cũng rất cao. Giá thành sản xuất cao là do Việt Nam còn nhiều khâu thủ công trong sản xuất, thiếu sự liên kết ngành dọc trong chuỗi sản xuất, chưa ổn định được vùng nguyên liệu, cà phê xuất khẩu chủ yếu ở dạng thô nên sức cạnh tranh thấp, chất lượng nguyên liệu rất khó kiểm soát, chi phí vận chuyển cao. Ngoài ra, mặc dù mặt hàng cà phê Việt Nam có khả năng cạnh tranh khi có sự quan tâm của Chính phủ thông qua các chính sách hỗ trợ như chính sách đầu tư, tín dụng xuất khẩu, hỗ trợ áp dụng khoa học công nghệ tuy nhiên khi thực hiện các chính sách này nhà nước còn thiếu sự kiểm tra và đôn đốc chặt chẽ làm hạn chế tính hiệu quả của các chính sách này. Cũng theo Maurice and David (2011), chính vì yếu tố mùa vụ mà sự khác biệt trong vụ thu hoạch của quốc gia này cũng khác quốc gia khác dẫn đến việc không thể dự đoán được việc cung cấp cà phê trên thế giới. Điều này cũng sẽ ảnh hưởng đến giá cà phê thế giới và có tác động lan truyền đến giá cà phê các nước trong đó có Việt Nam, thêm nữa từ nghiên cứu của Nguyễn Văn Phúc và Tô Thị Kim Hồng (2014) giá cà phê thế giới và Việt Nam có mối liên hệ đồng liên kết do đó chúng có ảnh hưởng qua lại lẫn nhau. Cũng theo ý kiến chuyên gia, tác động của tỷ giá trong ngắn hạn ít khi ảnh hưởng đến giá xuất khẩu, chủ yếu phụ thuộc vào thời điểm ký kết hợp đồng. Nếu tỷ giá biến động nhiều trước khi ký kết hợp đồng mua bán thì số lượng cà phê xuất khẩu sẽ thay đổi,

tuy nhiên sau khi ký kết hợp đồng mà tỷ giá thay đổi thì các hợp đồng này sẽ được điều chỉnh về giá bán.

Căn cứ trên kết quả hiệu ứng giá và lượng, cơ cấu và sự biến động thị trường và theo ý kiến của các chuyên gia được phỏng vấn, mặt hàng cà phê có khả năng cạnh tranh với phần lớn các nước khác do xuất khẩu của Việt Nam không chủ yếu dựa vào lượng mà dựa vào giá; kinh nghiệm và tay nghề của người sản xuất được đánh giá rất cao. Việt Nam tham gia thị trường cà phê thế giới cũng khá lâu (trên 34 năm) và đã gia nhập được vào thị trường của các nước phát triển với tỷ trọng trên 74% (Đức 28%, Ý 14%, Tây Ban Nha 13% Mỹ 19%) với thị trường ngày càng mở rộng. Bên cạnh nguồn lực lao động dồi dào nên chi phí thấp dẫn đến giá thành cạnh tranh; thu hút được vốn đầu tư trong và ngoài nước, Việt Nam đã ký kết nhiều hiệp định thương mại với các quốc gia; nhiều doanh nghiệp có kinh nghiệm và kỹ năng kinh doanh quốc tế mặt hàng cà phê. Tuy nhiên, để khẳng định vị trí của cà phê Việt Nam trên thị trường thế giới cũng như tiếp tục nâng cao khả năng cạnh tranh của mặt hàng này, Việt Nam cũng cần thực hiện một số việc quan trọng sau đây: đảm bảo về chất lượng và an toàn sức khỏe cho người tiêu dùng; đảm bảo vấn đề về truy xuất nguồn gốc; tham gia chuỗi cung ứng toàn cầu; nâng cao hiệu quả và tính thực tiễn thực tiễn của những Chính sách hỗ trợ, khuyến khích đối với người sản xuất, người kinh doanh (đặc biệt là chính sách tín dụng, hỗ

trợ áp dụng khoa học công nghệ); xây dựng hệ thống giao thông nhằm giảm chi phí vận chuyển.

4. Kết luận

Việc xác định các yếu tố tác động đến sự biến động giá xuất khẩu là công việc cần thiết nhằm giúp cho quốc gia có thể dự đoán trước những sự biến động và từ đó có thể có phương án dự phòng rủi ro. Nghiên cứu này sử dụng phương pháp định tính và phương pháp định lượng để đánh giá những yếu tố chính ảnh hưởng đến giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam. Qua quan sát và phân tích 34 năm biến động của giá cà phê, cho thấy giá cà phê biến động có tính chu kỳ tăng 5 năm và chu kỳ giảm 7 năm. Kết quả phân tích mô hình logarit kép có thể thấy giá xuất khẩu của Brazil có vai trò rất lớn trong việc dự báo giá xuất khẩu cà phê của Việt Nam. Khi giá cà phê Brazil tăng 1%, giá cà phê xuất khẩu của Việt Nam có xu hướng tăng 0,31%.

Do đó, để xuất khẩu bền vững Việt Nam cần tập trung và phát triển các thị trường có tính ổn định và cần đầu tư nhiều hơn vào thương hiệu, chất lượng sản phẩm. Nếu dựa vào hiệu ứng giá lượng: khả năng cạnh tranh của Việt Nam trên thị trường thế giới tốt hơn bởi vì chúng ta xuất khẩu dựa vào hiệu ứng giá trong khi Brazil là đối thủ cạnh tranh rất mạnh với Việt Nam lại dựa nhiều vào lượng để xuất khẩu. Trong khi đó, cà phê Colombia lại có một phân khúc thị trường khác khi quốc gia này tập trung vào sản xuất cà phê arabica trong khi Việt Nam chủ yếu xuất khẩu cà phê robusta trên thị trường thế giới.

TÀI LIỆU THAM KHẢO

- [1] Barcena A., 2011. Price volatility in agricultural markets (2000 - 2010): *Implications for Latin America and policy options, The Outlook for Agriculture and Rural Development in the Americas: A Perspective on Latin America and the Caribbean*, Newsletter ECLAC/FAO/ IICA, Number 1/.2011
- [2] Greenfield G., 2002. *Vietnam and the World Coffee Crisis: Local Coffee Riots in a Global Context*. National coffee Growers Association (Anacafe) (2002).
- [3] Sekhar C. S. C., 2003. Price Formation in World Wheat Markets – Implications for Policy. *Journal of Policy Modeling*. Volume 25(1), pp.85-106, January 2003.
- [4] Tomex W. G. and Robinson K. L., 2003. *Agricultural product prices*. Cornell university press.
- [5] Hồ Thị Hoàng Lương, *Nghiên cứu sự biến động của giá nông sản dưới lăng kính kinh tế học*, Khoa Quản trị kinh doanh, Trường Đại học Kinh tế Nghệ An.

- [6] Goodwin B. K. and Holt M. T., 1999. Price Transmission and Asymmetric Adjustment in the U. S. Beef Sector. *American Journal of Agricultural Economics*, 81(3), pp.630-637.
- [7] Engle C. and Quagrainie K., 2009. *Aquaculture Marketing Handbook*. Wiley - Blackwell Publishing Inc. 288pp
- [8] Tổng cục thống kê, 2011. *Phương pháp điều tra giá xuất nhập khẩu hàng hóa (thời kỳ 2010-2015)*.
- [9] Tổ chức Lương thực và Nông nghiệp Liên Hiệp Quốc (FAO – Food and Agriculture Organization of the United Nations), 2015. *Rice Market Monitor*.
- [10] Ymkella K. K., Unnevehr J. L. and Garcia P., 1994. Noncompetitive Pricing And Exchange Rate Pass-Through In Selected U.S. And Thai Rice Markets. *Journal of Agricultural and Applied Economics*.
- [11] Deodhar Y. S. and Sheldon M. I., 1997. Market Power in the World Market for Soymeal Exports. *Journal of Agricultural and Resource Economics* 22(1), pp.78-86
- [12] Pindyck S. R. and Rubinfeld L. D., 1999. *Kinh tế học vi mô*, sách dịch bởi Trường Đại học kinh tế quốc dân.
- [13] Hackner J., 2000. A note on price and quantity competition in differentiated oligopolies. *Journal of Economic theory*, volume 93, issue 2, August 2000, pp.233–239.
- [14] Singh N. and Vives X., 1984. Price and quantity competition in a differentiated duopoly. *Rand journal of Economics*, volume 15, pp.546-554.
- [15] Carlton W. D. and Perloff M. J., 2000. *Textbook “Modern industrial organization”*, third edition, chapter 6.
- [16] Xavier V., 1985. On the efficiency of Bertrand and Cournot equilibria with product differentiation, *Journal of Economic Theory*, Vol. 36, pp.166-175.
- [17] Andrew, M. K. and James, K. N., 2002. *Coffee prices and regulatin and their impact on livelihoods of rural community in Kenya*, Tegemeo Institute of Agricultural Policy and Development Egerton University.
- [18] Craves J., 2006. “*The coffee crisis*”, *coffeehabitat.com*, downloaded at: http://www.coffeehabitat.com/2006/02/the_coffee_cris/
- [19] Keith, Flury, 2014. *Agricultural Strategist. Coffee and Currencies*. BNP Paribas corporate and investment banking
- [20] Maurice N. E. and David J., 2011. *Unravelling the underlying causes of price volatility in world coffee and cocoa commodity markets*.
- [21] Baffes J., 2008. *Coffee Industry*, International Encyclopedia of the Social Sciences”, Macmillan Reference USA.
- [22] Nguyễn Văn Phúc và Tô Thị Kim Hồng, 2014. 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 TP.HCM*, số 4(37) tr.30-36.