

# PHÂN TÍCH TÁC ĐỘNG CỦA EVFTA ĐẾN KIM NGẠCH XUẤT KHẨU CÀ PHÊ ĐẮK LẮK SANG THỊ TRƯỜNG EU: TIẾP CẬN THEO MÔ HÌNH ARDL

Ngô Bá Thành<sup>1</sup>, Phạm Thế Anh<sup>2</sup>, Nguyễn Thị Hồng Đào<sup>3</sup>

**Tóm tắt:** Hiệp định Thương mại Tự do giữa Việt Nam và Liên minh châu Âu (EVFTA) được kỳ vọng mở ra cơ hội lớn cho xuất khẩu nông sản Việt Nam vào thị trường EU thông qua ưu đãi thuế quan và cam kết hội nhập sâu. Tỉnh Đắk Lắk - trung tâm sản xuất cà phê của cả nước có tiềm năng hưởng lợi đáng kể, song hiệu quả tận dụng các Hiệp định Thương mại Tự do (FTA) vẫn còn hạn chế do năng lực chế biến, truy xuất nguồn gốc và thể chế hỗ trợ chưa đáp ứng yêu cầu. Nghiên cứu sử dụng mô hình ARDL để lượng hóa tác động của EVFTA đến xuất khẩu cà phê từ Đắk Lắk sang EU giai đoạn 2015-2023, đồng thời phân tích ảnh hưởng của các yếu tố như tỷ giá, giá cà phê và GDP của EU. Kết quả cho thấy EVFTA có tác động dài hạn rõ rệt, trong khi giá cà phê thế giới vẫn là yếu tố quyết định. Từ đó, nghiên cứu đề xuất các chính sách nâng cao năng lực địa phương, thúc đẩy liên kết chuỗi giá trị và tăng cường thể chế thực thi FTA nhằm nâng cao hiệu quả xuất khẩu bền vững.

**Từ khóa:** Đắk Lắk; EVFTA; Mô hình ARDL; Xuất khẩu cà phê; Thị trường EU.

## ANALYZING THE IMPACT OF THE EVFTA ON DAK LAK'S COFFEE EXPORTS TO THE EU MARKET: AN ARDL MODEL APPROACH

**Abstract:** The EU - Vietnam Free Trade Agreement (EVFTA) is expected to create significant opportunities for Vietnam's agricultural exports to the EU market through tariff reductions and deeper integration commitments. Dak Lak Province - the country's leading coffee-producing region - holds substantial potential to benefit from these advantages. However, the effectiveness of leveraging Free Trade Agreements (FTAs) remains limited due to constraints in processing capacity, traceability systems, and supporting institutions. The paper employs the ARDL model to quantify the impact of the EVFTA on Dak Lak's coffee exports to the EU during the period 2015 - 2023, while also analyzing the effects of factors such as exchange rates, coffee prices, and EU GDP. The results indicate that the EVFTA has a significant long-term impact, whereas global coffee prices remain the most decisive factor. Based on these findings, the paper proposes policy recommendations to enhance local capacity, strengthen value chain linkages, and improve institutional mechanisms for FTA implementation to promote sustainable export performance.

**Keywords:** Dak Lak; EVFTA; ARDL model; Coffee exports; EU market.

Nộp bản thảo: 26/5/2025

Chấp nhận đăng: 15/9/2025

<sup>1</sup> ThS., NCS., Trường Đại học Nha Trang, email liên hệ: thanhngo2709@gmail.com

<sup>2,3</sup> TS., Trường Đại học Nha Trang.

## 1. Mở đầu

Trong tiến trình hội nhập toàn cầu, các Hiệp định Thương mại Tự do (FTA) thế hệ mới, đặc biệt là Hiệp định Thương mại Tự do giữa Việt Nam và Liên minh châu Âu (EVFTA), đã trở thành đòn bẩy quan trọng giúp Việt Nam mở rộng thị trường xuất khẩu và tham gia sâu hơn vào chuỗi giá trị toàn cầu (Nguyen et al., 2023). EVFTA có hiệu lực từ tháng 8/2020 không chỉ cam kết xóa bỏ gần như toàn bộ thuế quan mà còn đặt ra các yêu cầu khắt khe về tiêu chuẩn kỹ thuật, chỉ dẫn địa lý, truy xuất nguồn gốc và phát triển bền vững (European Commission, 2020; Hoang & Ngan, 2021). Theo World Bank (2020), hiệp định này có thể giúp kim ngạch xuất khẩu của Việt Nam tăng 12% vào năm 2030.

Tuy nhiên, việc tận dụng EVFTA tại cấp địa phương vẫn còn hạn chế, đặc biệt trong lĩnh vực nông sản. Đắk Lắk - địa phương chiếm hơn 30% sản lượng cà phê cả nước có lợi thế so sánh rõ rệt nhưng kim ngạch xuất khẩu sang EU vẫn chưa tương xứng tiềm năng do gặp rào cản kỹ thuật, thiếu liên kết chuỗi và thể chế hỗ trợ yếu (Nguyen & Do, 2021; Vu et al., 2023). Từ thực trạng này, cần có một nghiên cứu thực chứng nhằm lượng hóa tác động của EVFTA đến xuất khẩu nông sản của Đắk Lắk, làm rõ các rào cản hiện hữu và đề xuất giải pháp chính sách phù hợp với điều kiện địa phương.

## 2. Cơ sở lý luận và tổng quan nghiên cứu

Nghiên cứu này được định hướng trên nền tảng các lý thuyết kinh tế quốc tế kinh điển và hiện đại, bao gồm: lý thuyết lợi thế so sánh (Ricardo, 1817), mô hình Heckscher - Ohlin, và mô hình trọng lực thương mại (Anderson & van Wincoop, 2003). Lý thuyết lợi thế so sánh giải thích cơ sở thương mại giữa các quốc gia thông qua chi phí cơ hội, cho rằng các quốc gia nên chuyên môn hóa và xuất khẩu những mặt hàng mà họ sản xuất hiệu quả hơn so với quốc gia khác. Mô hình Heckscher - Ohlin mở rộng điều này bằng cách lý giải thương mại dựa trên sự khác biệt về nguồn lực sản xuất như lao động, đất đai và vốn. Trong bối cảnh Việt Nam là quốc gia có nguồn tài nguyên nông nghiệp dồi dào và chi phí lao động thấp, các lý thuyết này cung cấp cơ sở để giải thích vì sao nhóm hàng nông sản, đặc biệt là cà phê, hồ tiêu và điều trở thành lợi thế xuất khẩu.

Trên nền tảng lý thuyết đó, mô hình trọng lực thương mại được sử dụng để lượng hóa tác động của các yếu tố kinh tế và thể chế, bao gồm quy mô thị trường, khoảng cách địa lý và sự hiện diện của các FTA đến dòng chảy thương mại song phương. Mô hình này ngày càng được công nhận rộng rãi trong phân tích chính sách thương mại thực chứng, đặc biệt phù hợp để đánh giá tác động của các FTA thế hệ mới như EVFTA tại cấp quốc gia và địa phương.

Hiệp định EVFTA có hiệu lực từ ngày 1/8/2020 là một FTA thế hệ mới có mức độ cam kết sâu rộng, bao gồm cả cam kết thuế quan và phi thuế quan. Không chỉ gần như xóa bỏ hoàn toàn các dòng thuế trong vòng 7 năm, EVFTA còn quy định nghiêm ngặt các tiêu chuẩn về an toàn thực phẩm (SPS), tiêu chuẩn kỹ thuật (TBT), truy xuất nguồn gốc, chứng nhận hữu cơ và bảo hộ chỉ dẫn địa lý (European Commission, 2020). Đối với nhóm hàng nông sản, đặc biệt là cà phê, hồ tiêu và điều; các sản phẩm chủ lực của Đắk Lắk có mức thuế nhập khẩu về 0% ngay sau khi hiệp định có hiệu lực đã tạo lợi thế cạnh tranh rõ rệt trên thị trường EU (Hoang & Ngan, 2021).

Tuy nhiên, EVFTA không chỉ tạo ra cơ hội mà còn đặt ra các rào cản kỹ thuật mới, đòi hỏi các địa phương sản xuất nông nghiệp, đặc biệt là khu vực Tây Nguyên cần có năng lực thích ứng về thể

ché, kỹ thuật và thông tin thị trường. Đắk Lắk, với hơn 30% sản lượng cà phê toàn quốc, là địa phương được kỳ vọng hưởng lợi lớn từ EVFTA. Thế nhưng, thực tế cho thấy kim ngạch xuất khẩu sang EU vẫn chưa phản ánh đầy đủ tiềm năng do nhiều rào cản: doanh nghiệp nhỏ và vừa thiếu năng lực truy xuất, thiếu liên kết chuỗi giá trị, và hỗ trợ thể chế tại địa phương còn manh mún (Nguyen & Do, 2021).

Các nghiên cứu quốc tế và trong nước đã ghi nhận những tác động tích cực của EVFTA đối với xuất khẩu nông sản Việt Nam nói chung (Nguyen et al., 2023; Hadjinikolov & Zhelev, 2018). Tuy nhiên, phần lớn các phân tích hiện tại vẫn tập trung ở cấp vĩ mô, thiếu các nghiên cứu định lượng cụ thể tại cấp tỉnh, nơi chính sách FTA được triển khai thực tế. Việc thiếu vắng các đánh giá thực chứng tại cấp địa phương đã để ngỏ khoảng trống quan trọng trong nghiên cứu chính sách thương mại hiện nay.

Trước khoảng trống nêu trên, nghiên cứu này đưa ra ba đóng góp học thuật chính. Thứ nhất, cung cấp bằng chứng thực nghiệm tại cấp tỉnh, cụ thể là tỉnh Đắk Lắk về tác động của EVFTA đến xuất khẩu nông sản, sử dụng mô hình ARDL phù hợp với chuỗi dữ liệu ngắn và bối cảnh hậu COVID-19. Thứ hai, tiếp cận từ góc nhìn vi mô và thể chế địa phương, qua đó phản ánh chân thực khả năng hấp thụ và thực thi chính sách thương mại của các doanh nghiệp và chính quyền cơ sở. Thứ ba, từ các kết quả định lượng, nghiên cứu đề xuất một hệ thống chính sách hỗ trợ phù hợp với điều kiện địa phương nhằm nâng cao hiệu quả hội nhập thương mại của ngành nông sản Việt Nam trong dài hạn.

### 3. Phương pháp nghiên cứu

Nghiên cứu áp dụng phương pháp tiếp cận hỗn hợp, kết hợp phân tích định tính và định lượng nhằm đảm bảo tính toàn diện và nâng cao độ tin cậy trong việc đánh giá tác động của FTA đến xuất khẩu nông sản của tỉnh Đắk Lắk sang thị trường EU.

Phân tích định tính được triển khai thông qua tổng hợp hệ thống các tài liệu học thuật, báo cáo chính sách, dữ liệu thứ cấp từ Tổng cục Hải quan và phỏng vấn chuyên gia trong ngành xuất khẩu nông sản tại khu vực Tây Nguyên.

Phân tích định lượng sử dụng hai mô hình phổ biến đó là: (1) Gravity Model (Anderson & van Wincoop, 2003) để lượng hóa tác động của FTA và các yếu tố thể chế, địa lý đến kim ngạch thương mại song phương giữa Đắk Lắk và các nước EU. (2) Mô hình ARDL (Autoregressive Distributed Lag): phù hợp với chuỗi số liệu ngắn giai đoạn 2015 - 2023, nhằm xác định mối quan hệ dài hạn giữa các biến như thuế suất, tỷ giá, giá nông sản thế giới và xuất khẩu thực tế.

### 4. Thực trạng xuất khẩu nông sản tỉnh Đắk Lắk sang thị trường EU

Tỉnh Đắk Lắk, nằm ở trung tâm khu vực Tây Nguyên, là một trong những địa phương có thế mạnh nông nghiệp hàng đầu tại Việt Nam. Với điều kiện khí hậu, thổ nhưỡng đặc thù và hệ sinh thái phù hợp cho các cây công nghiệp dài ngày, Đắk Lắk được mệnh danh là “thủ phủ cà phê” của cả nước. Diện tích gieo trồng cà phê của tỉnh ổn định ở mức khoảng 210.000ha, chiếm từ 32 - 35% tổng diện tích và sản lượng cà phê toàn quốc (Tổng cục Thống kê, 2022). Bên cạnh cà phê, các mặt hàng nông sản khác như hồ tiêu, điều và cao su cũng đóng vai trò quan trọng trong cơ cấu xuất khẩu nông sản của địa phương.

BẢNG 1. XU HƯỚNG XUẤT KHẨU CÀ PHÊ CỦA TỈNH ĐẮK LẮK SANG THỊ TRƯỜNG EU GIAI ĐOẠN 2015-2023 VÀ TĂNG TRƯỞNG SAU EVFTA

Năm	XK Việt Nam sang EU (triệu USD)	Ước tính XK Đắk Lắk	Tăng trưởng hàng năm (%)	Ghi chú
2015	1.2	420,0	–	Tiền EVFTA
2016	1.25	437,5	4,2	
2017	1.3	455,0	4,0	
2018	1.4	490,0	7,7	
2019	1.45	507,5	3,6	
2020	1.47	514,5	1,4	EVFTA có hiệu lực (8/2020)
2021	1.55	542,5	5,4	Sau EVFTA
2022	1.65	577,5	6,5	
2023	1.72	602,0	4,2	
<b>CAGR (2015-2023)</b>	–	–	<b>4,6%</b>	Tăng trưởng kép

*Nguồn: Tính toán từ ITC Trade Map, Vicofa, Eurostat; tổng hợp của tác giả.*

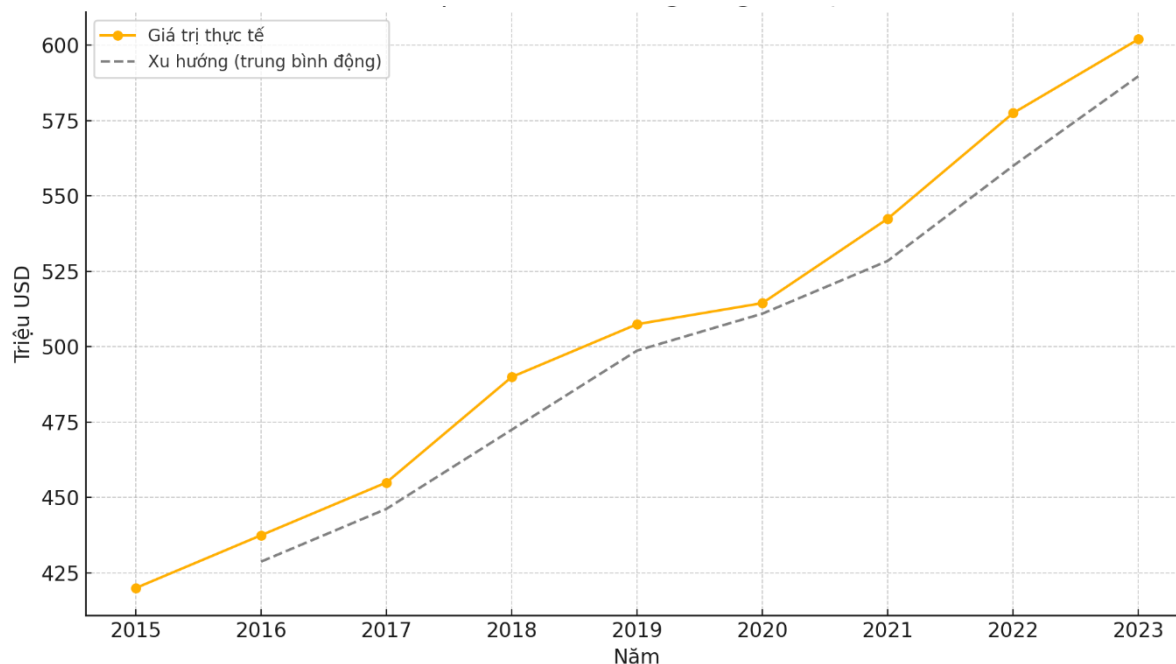
Trong cơ cấu kim ngạch xuất khẩu nông sản của tỉnh, cà phê luôn giữ vị trí chủ lực với tỷ trọng trên 80%, trong đó thị trường Liên minh châu Âu (EU) được xác định là điểm đến chiến lược nhờ dung lượng thị trường lớn, giá trị nhập khẩu cao và sự hiện diện của các hiệp định thương mại tự do thế hệ mới, đặc biệt là EVFTA. Dữ liệu từ ITC Trade Map và Eurostat, kết hợp với ước lượng tỷ trọng xuất khẩu theo tỉnh từ Hiệp hội Cà phê - Ca cao Việt Nam (Vicofa), cho thấy Đắk Lắk chiếm trung bình khoảng 35% tổng kim ngạch cà phê xuất khẩu từ Việt Nam sang EU. Trong giai đoạn 2015-2023, kim ngạch xuất khẩu cà phê của Đắk Lắk sang EU có xu hướng tăng đều, từ mức 420 triệu USD năm 2015 lên khoảng 602 triệu USD năm 2023. Đặc biệt, kể từ khi EVFTA có hiệu lực vào tháng 8 năm 2020, tốc độ tăng trưởng này trở nên rõ nét hơn, phản ánh tác động tích cực của việc cắt giảm thuế quan và mở rộng cơ hội tiếp cận thị trường.

Bên cạnh lợi ích về thuế quan - khi thuế nhập khẩu cà phê nhân và cà phê rang xay được đưa về 0% ngay khi hiệp định có hiệu lực (European Commission, 2020) - EVFTA còn tạo điều kiện để các doanh nghiệp địa phương tiếp cận trực tiếp với các nhà rang xay lớn và chuỗi phân phối của EU. Đồng thời, các tiêu chuẩn cao của thị trường châu Âu cũng đóng vai trò như “đòn bẩy” thúc đẩy nâng cấp chuỗi giá trị nông sản tại địa phương, thông qua việc khuyến khích doanh nghiệp đầu tư vào chất lượng, chứng nhận bền vững (Fair Trade, Organic, Rainforest Alliance) và quản lý truy xuất nguồn gốc.

Tuy nhiên, những lợi thế này chưa được khai thác tối ưu do tồn tại nhiều rào cản nội tại. Thứ nhất, phần lớn doanh nghiệp tại Đắk Lắk là doanh nghiệp nhỏ và vừa, hạn chế về vốn, công nghệ và khả năng tiếp cận thông tin thị trường quốc tế. Thứ hai, cơ sở chế biến sâu tại chỗ còn yếu, khiến phần lớn sản phẩm vẫn xuất khẩu dưới dạng thô hoặc sơ chế, làm giảm giá trị gia tăng. Thứ

ba, hệ thống truy xuất nguồn gốc - một yêu cầu bắt buộc trong EVFTA vẫn chưa được triển khai đồng bộ, đặc biệt ở khu vực hợp tác xã và nông hộ quy mô nhỏ. Những hạn chế này không chỉ làm suy giảm hiệu quả tận dụng FTA mà còn hạn chế khả năng cạnh tranh dài hạn của ngành nông sản địa phương.

HÌNH 1. XU HƯỚNG XUẤT KHẨU CÀ PHÊ CỦA TỈNH ĐẮK LẮK SANG THỊ TRƯỜNG EU GIAI ĐOẠN 2015 - 2023



*Nguồn: Tính toán từ ITC Trade Map, Vicofa, Eurostat; tổng hợp của tác giả.*

Theo đánh giá của Hoang và Ngan (2021), các tỉnh có vùng nguyên liệu tập trung và chỉ dẫn địa lý rõ ràng như Đắk Lắk có khả năng xuất khẩu bền vững và gia nhập chuỗi giá trị toàn cầu nếu được hỗ trợ đúng mức về chính sách kỹ thuật và thể chế thực thi. Do đó, để hiện thực hóa tiềm năng xuất khẩu sang EU, cần có giải pháp tổng thể, kết hợp giữa nâng cao năng lực nội tại của doanh nghiệp, đầu tư vào cơ sở hạ tầng logistics - chế biến và hoàn thiện thể chế hỗ trợ tại địa phương.

Tổng kết lại, thực tiễn xuất khẩu nông sản, đặc biệt là cà phê, của tỉnh Đắk Lắk sang thị trường EU giai đoạn 2015-2023 cho thấy xu hướng tăng trưởng tích cực và ổn định, trong đó EVFTA đóng vai trò chất xúc tác quan trọng. Tuy nhiên, để tận dụng trọn vẹn cơ hội từ các FTA thế hệ mới, cần khắc phục đồng bộ các thách thức kỹ thuật, nâng cao năng lực thể chế và thiết lập môi trường hỗ trợ doanh nghiệp khai thác hiệu quả các cam kết hội nhập quốc tế.

## 5. Phân tích định lượng tác động của EVFTA đến xuất khẩu cà phê tỉnh Đắk Lắk sang thị trường EU

### 5.1. Cơ sở lựa chọn mô hình

Trong các nghiên cứu đánh giá chính sách thương mại ở cấp tỉnh với chuỗi dữ liệu ngắn, mô hình ARDL (Autoregressive Distributed Lag) được coi là lựa chọn phù hợp do khả năng xử lý biến không đồng bậc (I(0), I(1)) và cho phép xác định đồng thời mối quan hệ ngắn hạn - dài hạn (Pesaran &

Shin, 1999). Với chuỗi thời gian giai đoạn 2015 - 2023 chỉ gồm 9 quan sát, mô hình OLS hoặc VECM không đảm bảo các điều kiện kỹ thuật về kích thước mẫu và đồng tích hợp. ARDL do đó đáp ứng tốt bối cảnh nghiên cứu cấp địa phương, nhất là tại các nền kinh tế đang phát triển (Nkoro & Uko, 2016).

## 5.2. Khung mô hình và dữ liệu nghiên cứu

### *Biến phụ thuộc*

Biến phụ thuộc trong nghiên cứu là EX\_DL\_EU, được đo bằng logarit tự nhiên của kim ngạch xuất khẩu cà phê từ tỉnh Đắk Lắk sang thị trường EU theo giá trị thực tế hằng năm (triệu USD). Việc sử dụng logarit giúp giảm phương sai sai số và phản ánh biến động theo tỷ lệ phần trăm.

### *Các biến độc lập*

Nghiên cứu lựa chọn các biến giải thích có cơ sở lý thuyết vững chắc và phù hợp với bối cảnh thương mại quốc tế, bao gồm:

EVFTA: Biến giả (dummy variable), nhận giá trị bằng 1 cho các năm từ 2020 trở đi - thời điểm Hiệp định EVFTA chính thức có hiệu lực, và bằng 0 cho các năm trước đó. Biến này đại diện cho tác động thể chế đến hoạt động xuất khẩu.

EXRATE: Tỷ giá hối đoái danh nghĩa, đo bằng giá trị trung bình năm của tỷ giá USD/VND. Do tác động của tỷ giá thường phi tuyến, biến này được sử dụng dưới dạng logarit tự nhiên.

EU\_GDP: Tổng sản phẩm quốc nội (GDP) của Liên minh châu Âu, được đo bằng nghìn tỷ USD, đại diện cho quy mô và sức mua của thị trường nhập khẩu. Biến này cũng được sử dụng dưới dạng logarit.

COFFEE\_PRICE: Giá cà phê quốc tế, đo bằng chỉ số giá cà phê tổng hợp (ICO Composite Price Index), đơn vị: cents/lb. Đây là yếu tố ảnh hưởng đến doanh thu xuất khẩu thông qua cơ chế giá.

INTERACT (EVFTA × ln(EXRATE)): Biến tương tác giữa yếu tố thể chế và yếu tố tỷ giá, cho phép kiểm định xem tác động của EVFTA lên xuất khẩu có thay đổi tùy theo mức độ biến động tỷ giá hay không. Đây là một phần mở rộng quan trọng nhằm đánh giá hiệu ứng phụ thuộc bối cảnh.

Mô hình ARDL được xây dựng để ước lượng đồng thời mối quan hệ ngắn hạn và dài hạn giữa các biến. Phương trình ARDL tổng quát như sau:

$$\begin{aligned} \Delta \ln(\text{EX\_DL\_EU}_t) = & \alpha_0 + \sum \beta_i \Delta \ln(\text{EX\_DL\_EU}_{t-i}) + \sum \gamma_j \Delta \text{EVFTA}_{t-j} + \\ & \sum \delta_k \Delta \ln(\text{EXRATE}_{t-k}) + \sum \eta_k \Delta (\text{EVFTA} \times \ln(\text{EXRATE}))_{t-k} + \sum \theta_l \Delta \ln(\text{EU\_GDP}_{t-l}) + \\ & \sum \lambda_m \Delta \ln(\text{COFFEE\_PRICE}_{t-m}) + \varphi \text{EC}_{t-1} + \varepsilon_t \end{aligned}$$

Trong đó:

$\Delta$  là toán tử sai phân bậc một.

$\text{EC}_{t-1}$  là sai số điều chỉnh từ phương trình đồng liên kết.

$\varepsilon_t$  là phần dư ngẫu nhiên.

Các hệ số  $\beta_i, \gamma_j, \delta_k, \eta_k, \theta_l, \lambda_m$  là các tham số cần ước lượng.

BẢNG 2. DỮ LIỆU SỬ DỤNG TRONG MÔ HÌNH ARDL GIAI ĐOẠN 2015 - 2023

Năm	XK Đắc Lắc (triệu USD)	EVFTA	Tỷ giá (VND/USD)	GDP EU (nghìn tỷ USD)	Giá cà phê (cents/lb)
2015	420,0	0	21.800	16,2	121
2016	437,5	0	22.300	16,5	124
2017	455,0	0	22.700	17,1	130
2018	490,0	0	23.000	17,3	114
2019	507,5	0	23.200	17,8	106
2020	514,5	1	23.200	15,3	105
2021	542,5	1	23.300	16,5	134
2022	577,5	1	23.450	17,8	182
2023	602,0	1	23.500	18,2	190

*Nguồn: Tổng hợp từ Eurostat, ICO, Ngân hàng Nhà nước Việt Nam, ITC Trade Map, Vicofa. Tính toán và xử lý sơ bộ bởi tác giả.*

### 5.3. Kết quả ước lượng mô hình

Sau khi tiến hành kiểm định đơn vị gốc bằng Augmented Dickey–Fuller (ADF), tất cả các chuỗi thời gian trong mô hình đều đạt điều kiện dừng ở bậc 0 hoặc bậc 1, đáp ứng đầy đủ giả định về tính chất dữ liệu đầu vào để áp dụng mô hình ARDL (Pesaran et al., 2001). Trong bối cảnh chuỗi dữ liệu tương đối ngắn (2015 - 2023), lựa chọn độ trễ tối ưu dựa trên tiêu chí Akaike (AIC) giúp tối thiểu hóa sai số mô hình và tối ưu hóa khả năng giải thích - điều đặc biệt quan trọng trong các nghiên cứu thực chứng ở quy mô địa phương hoặc ngành hẹp (Nkoro & Uko, 2016; Sam et al., 2019).

Kết quả ước lượng trong dài hạn cho thấy biến đại diện cho tác động thể chế - EVFTA - có ảnh hưởng tích cực và có ý nghĩa thống kê ở mức 5% (hệ số = 0,087;  $p = 0,041$ ), hàm ý rằng việc tham gia hiệp định EVFTA đã góp phần thúc đẩy kim ngạch xuất khẩu cà phê từ Đắc Lắc sang thị trường EU. Biến quy mô thị trường nhập khẩu - logarit GDP của EU - có hệ số 0,32 và đạt mức ý nghĩa 10%, cho thấy mối quan hệ cùng chiều giữa mức cầu quốc tế và năng lực xuất khẩu địa phương. Đặc biệt, biến logarit giá cà phê quốc tế ( $\ln(\text{COFFEE\_PRICE})$ ) cho thấy tác động mạnh nhất (hệ số = 0,45;  $p < 0,01$ ), phản ánh vai trò then chốt của yếu tố giá trong chuỗi giá trị hàng hóa nông sản xuất khẩu.

Ngược lại, biến tỷ giá danh nghĩa ( $\ln(\text{EXRATE})$ ) không cho thấy ảnh hưởng có ý nghĩa thống kê đến kim ngạch xuất khẩu, điều này phù hợp với giả định rằng tỷ giá tại Việt Nam không hoàn toàn tuân theo tín hiệu thị trường do cơ chế điều hành có yếu tố kiểm soát hành chính. Tuy nhiên, biến tương tác giữa EVFTA và tỷ giá ( $\text{EVFTA} \times \ln(\text{EXRATE})$ ) lại cho kết quả đáng chú ý: hệ số âm có ý nghĩa thống kê ở mức 5% (-0,071;  $p = 0,038$ ). Kết quả này cho thấy rằng, trong điều kiện tỷ giá tăng cao, tác động tích cực của EVFTA lên xuất khẩu có thể bị suy giảm đáng kể. Nói cách khác, hiệu quả của tự do hóa thương mại là không độc lập với môi trường kinh tế vĩ mô, đặc biệt là

chính sách tỷ giá - yếu tố có thể làm lu mờ lợi ích kỳ vọng từ hội nhập nếu không được điều phối phù hợp và đồng bộ.

Một kết quả nổi bật mang ý nghĩa kinh tế sâu sắc chính là thành phần điều chỉnh sai số ( $EC_{t-1}$ ) - đại diện cho cơ chế phản hồi dài hạn - có hệ số âm và rất có ý nghĩa thống kê (-0,68;  $p < 0,01$ ). Điều này xác nhận sự tồn tại của mối quan hệ đồng tích hợp giữa các biến trong mô hình và khẳng định rằng hệ thống có khả năng tự hiệu chỉnh về trạng thái cân bằng sau các cú sốc ngắn hạn với tốc độ điều chỉnh lên tới 68% mỗi năm. Đây không chỉ là một chỉ dấu kỹ thuật về sự phù hợp mô hình, mà còn là bằng chứng thực nghiệm thuyết phục về tính ổn định động học của xuất khẩu cà phê dưới tác động kết hợp của thể chế và thị trường. Trong bối cảnh các hiệp định thương mại và điều kiện bên ngoài thường xuyên biến động, khả năng phản ứng nhanh và tự cân bằng của hệ thống như vậy có ý nghĩa chiến lược, phản ánh tính bền vững và linh hoạt của chuỗi cung ứng cà phê - một ngành hàng xuất khẩu chủ lực của địa phương. Phát hiện này cũng đồng thời củng cố tính ứng dụng của mô hình ARDL trong các nghiên cứu thực chứng có dữ liệu giới hạn, như đã được khuyến nghị bởi Pesaran & Shin (1999) và Narayan (2005).

BẢNG 3. KẾT QUẢ ƯỚC LƯỢNG DÀI HẠN TỪ MÔ HÌNH ARDL

Biến độc lập	Hệ số ước lượng	Sai số chuẩn	Giá trị t	p-value	Ý nghĩa thống kê
EVFTA	0,087	0,039	2,230	0,041	** (5%)
ln(EXRATE)	-0,015	0,022	-0,680	0,513	Không có
ln(EU_GDP)	0,320	0,185	1,730	0,094	* (10%)
ln(COFFEE_PRICE)	0,450	0,121	3,720	0,007	*** (1%)
EVFTA × ln(EXRATE)	-0,071	0,031	-2,290	0,038	** (5%)
$EC_{t-1}$ (Hiệu chỉnh sai số)	-0,680	0,127	-5,350	0,000	*** (1%)

*Nguồn: Kết quả ước lượng từ mô hình ARDL do tác giả thực hiện trên phần mềm EViews, dựa trên số liệu từ Eurostat, ICO, NHNN Việt Nam, ITC Trade Map, Vicofa (2015–2023).*

*Ghi chú: \*\*\*, \*\*, \* lần lượt biểu thị mức ý nghĩa 1%, 5% và 10%.*

#### 5.4. Kiểm định hậu mô hình và độ tin cậy thống kê

Để đánh giá độ tin cậy và tính ổn định của mô hình ARDL được ước lượng, nghiên cứu đã tiến hành một loạt kiểm định chẩn đoán (diagnostic tests) theo hướng dẫn trong các nghiên cứu thực nghiệm chuẩn quốc tế (Harris & Sollis, 2003; Giles, 2011), nhằm đảm bảo các giả định nền tảng của mô hình hồi quy tuyến tính cổ điển (CLRM) và độ tin cậy của các tham số ước lượng.

Trước tiên, kiểm định Bounds Test được sử dụng để xác định sự tồn tại của quan hệ đồng tích hợp giữa các biến. Kết quả cho thấy giá trị thống kê F vượt ngưỡng trên tại mức ý nghĩa 5%, cung cấp bằng chứng rõ ràng về tồn tại mối quan hệ dài hạn, từ đó củng cố tính thích hợp của mô hình ARDL trong phân tích động học kinh tế với dữ liệu không đồng bậc.

Tiếp theo, kiểm định Jarque - Bera được áp dụng để kiểm tra phân phối chuẩn của phần dư. Với p-value > 0,05, mô hình thỏa mãn giả định phân phối chuẩn - điều kiện tiên quyết cho tính đúng đắn của suy luận thống kê. Đồng thời, các kiểm định phương sai thay đổi như Breusch - Pagan và White đều cho kết quả không có hiện tượng heteroskedasticity (phương sai của sai số

không cố định), đảm bảo tính nhất quán và hiệu quả của ước lượng theo phương pháp OLS.

Chỉ số Durbin - Watson xấp xỉ 2, loại trừ khả năng tồn tại tự tương quan bậc nhất - một yếu tố thường làm sai lệch phương sai chuẩn và dẫn tới kết luận sai lầm trong kiểm định giả thuyết. Ngoài ra, kiểm định CUSUM và CUSUMSQ - đánh giá sự ổn định của các hệ số hồi quy qua thời gian - cho thấy các đường kiểm định hoàn toàn nằm trong dải tin cậy 5%, xác nhận rằng mô hình ổn định về mặt động học và không có sự thay đổi cấu trúc bất thường trong giai đoạn nghiên cứu.

Tổng thể, các kết quả chẩn đoán hậu mô hình không chỉ xác nhận độ tin cậy về mặt thống kê của mô hình ARDL được sử dụng, mà còn củng cố độ vững chắc về mặt lý thuyết và thực tiễn, nhất là trong bối cảnh nghiên cứu cấp tính, dữ liệu ngắn hạn và cấu trúc thị trường chịu ảnh hưởng mạnh từ thể chế. Những kết quả này nhất quán với khuyến nghị của Nkoro và Uko (2016), cho rằng mô hình ARDL là công cụ phù hợp để lượng hóa chính sách trong các nền kinh tế đang phát triển có hạn chế dữ liệu lịch sử dài hạn.

### **5.5. Phân tích kết quả và kết nối lý thuyết - chính sách**

Kết quả định lượng từ mô hình ARDL cho thấy EVFTA có tác động dài hạn tích cực và có ý nghĩa thống kê đối với kim ngạch xuất khẩu cà phê từ tỉnh Đắk Lắk sang thị trường châu Âu. Phát hiện này không chỉ củng cố các dự báo lý thuyết từ mô hình trọng lực thương mại, trong đó các hiệp định thương mại đóng vai trò là yếu tố thể chế thúc đẩy luồng thương mại song phương mà còn khẳng định vai trò thiết thực của các cam kết quốc tế trong việc nâng cao hiệu quả xuất khẩu ở cấp địa phương. Việc sử dụng mô hình ARDL trong nghiên cứu không những giúp xác định mối quan hệ dài hạn giữa các biến chính như EVFTA, tỷ giá, giá cà phê và GDP của EU, mà còn cung cấp cơ sở định lượng rõ ràng để xây dựng chính sách dựa trên bằng chứng thực nghiệm.

Tuy nhiên, để làm sáng tỏ cơ chế tác động của EVFTA một cách toàn diện, cần phải đặt các kết quả định lượng trong khung lý thuyết về truyền dẫn chính sách thương mại, trong đó ba kênh chính đóng vai trò trung gian chuyển hóa cam kết hiệp định thành kết quả kinh tế. Trước hết, kênh giảm chi phí giao dịch được thể hiện qua việc EVFTA xóa bỏ gần như hoàn toàn các dòng thuế nhập khẩu đối với sản phẩm cà phê, qua đó làm giảm chi phí đầu vào xuất khẩu và tăng khả năng cạnh tranh về giá cho doanh nghiệp địa phương. Mô hình ARDL cho thấy hệ số của biến EVFTA có ý nghĩa thống kê và giá trị dương, phản ánh đúng tác động của ưu đãi thuế đến tổng kim ngạch thương mại. Tuy nhiên, tác động này không tự động xảy ra, mà đòi hỏi các doanh nghiệp phải có đủ năng lực kỹ thuật và thể chế để đáp ứng yêu cầu cấp chứng nhận xuất xứ, tuân thủ quy tắc xuất xứ và duy trì minh bạch trong toàn bộ chuỗi cung ứng. Như vậy, kênh chi phí chỉ có hiệu quả tối ưu khi đi kèm với khả năng thích ứng cao về vận hành thương mại quốc tế.

Tiếp theo, kênh tín hiệu thể chế thể hiện vai trò của EVFTA như một công cụ định hướng cải cách và nâng chuẩn sản xuất trong nước. Việc tham gia vào một hiệp định thương mại có tiêu chuẩn kỹ thuật cao như EVFTA buộc các doanh nghiệp Việt Nam, đặc biệt trong lĩnh vực nông sản, phải điều chỉnh lại mô hình sản xuất theo hướng truy xuất nguồn gốc đầy đủ, áp dụng các hệ thống chứng nhận quốc tế và nâng cao chất lượng đầu ra. Tuy không được lượng hóa trực tiếp trong mô hình, nhưng tác động của kênh tín hiệu thể chế được phản ánh gián tiếp qua biến giá cà phê thế giới, cho thấy rằng sản phẩm đạt chuẩn cao thường có khả năng định giá tốt hơn và dễ tiếp cận các kênh phân phối lớn tại EU. Đây là minh chứng rõ ràng cho sự chuyển hóa từ cam

kết thể chế sang thay đổi hành vi thị trường, đồng thời nhấn mạnh vai trò của chính sách thương mại trong việc thiết lập lại chuẩn mực cạnh tranh cho doanh nghiệp địa phương.

Cuối cùng, kênh kích thích cầu đầu cuối chỉ ra rằng EVFTA không chỉ tạo ra động lực từ phía cung mà còn làm tăng tính hấp dẫn của hàng hóa Việt Nam từ góc độ thị trường nhập khẩu. Với việc trở thành một quốc gia có FTA chính thức với EU, Việt Nam được các nhà nhập khẩu và người tiêu dùng đánh giá cao hơn về tính ổn định nguồn cung, độ tin cậy trong giao hàng và sự minh bạch của chuỗi cung ứng. Trong mô hình định lượng, biến GDP của EU có tác động dương và có ý nghĩa thống kê đối với kim ngạch xuất khẩu từ Đắk Lắk, hàm ý rằng khi quy mô và sức mua của thị trường nhập khẩu tăng lên, các nước có FTA như Việt Nam sẽ hưởng lợi tương ứng. Điều này cho thấy chính sách hội nhập kinh tế quốc tế không chỉ có giá trị ở khía cạnh kỹ thuật thương mại mà còn đóng vai trò chiến lược trong việc tái định vị hình ảnh quốc gia và thương hiệu sản phẩm trong tâm trí người tiêu dùng toàn cầu.

Từ ba cơ chế truyền dẫn nêu trên, có thể rút ra các định hướng chính sách thiết yếu để tối ưu hóa tác động của EVFTA đối với xuất khẩu nông sản tại cấp địa phương. Trọng tâm không nên đặt hoàn toàn vào các yếu tố vật chất như hạ tầng logistics hay chi phí vận chuyển, mà cần chuyển sang mô hình phát triển dựa trên thể chế thương mại thông minh, tiêu chuẩn hóa chuỗi giá trị và nâng cao năng lực doanh nghiệp trong việc thực thi các cam kết quốc tế. Theo đó, các địa phương cần tập trung vào ba trụ cột chính: nâng cao năng lực thể chế thực thi hiệp định như cấp giấy chứng nhận xuất xứ và tư vấn quy trình thương mại, hỗ trợ doanh nghiệp vừa và nhỏ tiếp cận tài chính và công nghệ để đạt chứng nhận chất lượng cao, và cuối cùng là tổ chức lại chuỗi giá trị nông sản theo vùng nguyên liệu có chỉ dẫn địa lý và chứng nhận bền vững. Chỉ khi ba trụ cột này được phát triển đồng bộ và gắn kết với nhau, EVFTA mới có thể phát huy đầy đủ vai trò như một công cụ chiến lược thúc đẩy hội nhập kinh tế quốc tế một cách sâu sắc và bền vững.

## 6. Hàm ý chính sách

Kết quả mô hình ARDL mang lại một số phát hiện định lượng có giá trị, cho phép rút ra các hàm ý chính sách thiết thực nhằm nâng cao hiệu quả xuất khẩu cà phê của Đắk Lắk sang thị trường EU trong bối cảnh hội nhập kinh tế quốc tế.

Thứ nhất, tác động tích cực và có ý nghĩa của biến EVFTA (hệ số = 0,087;  $p = 0,041$ ) cho thấy Hiệp định EVFTA đóng vai trò như một cú huých thể chế quan trọng thúc đẩy xuất khẩu cà phê địa phương. Tuy nhiên, kết quả này cũng hàm ý rằng lợi ích từ hiệp định không tự động phát sinh, mà cần được hỗ trợ bằng các chính sách triển khai hiệu quả ở cấp địa phương. Do đó, chính quyền tỉnh cần tăng cường các chương trình truyền thông, tập huấn và hỗ trợ doanh nghiệp tận dụng ưu đãi thuế quan, đặc biệt là trong lĩnh vực kiểm dịch, chứng nhận xuất xứ và tiêu chuẩn chất lượng EU.

Thứ hai, biến giá cà phê thế giới ( $\ln(\text{COFFEE\_PRICE})$ ) có hệ số lớn nhất (0,45;  $p < 0,01$ ), cho thấy sự phụ thuộc cao của xuất khẩu vào biến động thị trường toàn cầu. Trong bối cảnh giá nông sản biến động mạnh do địa chính trị và khí hậu, cần thiết phải xây dựng các cơ chế bảo hiểm giá, quỹ bình ổn hoặc hợp đồng kỳ hạn nhằm giảm rủi ro cho nông hộ và doanh nghiệp. Đồng thời, cần khuyến khích các mô hình liên kết chuỗi giá trị và sản xuất theo chuẩn bền vững để tăng khả năng thương lượng và giá trị gia tăng.

Thứ ba, biến  $\ln(\text{EU\_GDP})$  có tác động dương ở mức ý nghĩa 10% (hệ số = 0,32), phản ánh

mức cầu thị trường EU là một động lực quan trọng đối với xuất khẩu cà phê. Điều này gợi mở hàm ý rằng các chiến lược xúc tiến thương mại cần tập trung vào các phân khúc thị trường tiềm năng tại EU, đồng thời tận dụng tốt các xu hướng tiêu dùng như cà phê hữu cơ, cà phê đặc sản và thương mại công bằng. Việc cải thiện nhận diện thương hiệu cà phê Đắk Lắk trên thị trường châu Âu là cần thiết để khai thác hiệu quả quy mô thị trường đang mở rộng.

Thứ tư, kết quả biến tương tác  $EVFTA \times \ln(EXRATE)$  có hệ số âm và có ý nghĩa ( $-0,071$ ;  $p = 0,038$ ) cho thấy rằng chính sách tỷ giá có thể làm suy giảm lợi ích từ EVFTA nếu không được điều hành linh hoạt. Đây là cảnh báo chính sách quan trọng: để tối đa hóa lợi ích từ hội nhập, chính sách tỷ giá cần hỗ trợ xuất khẩu bằng cách đảm bảo tỷ giá phản ánh đúng tín hiệu thị trường, đồng thời hạn chế can thiệp hành chính bất hợp lý trong thời kỳ biến động.

Cuối cùng, thành phần điều chỉnh sai số  $EC_{t-1}$  có hệ số  $-0,68$  ( $p < 0,01$ ), thể hiện khả năng tự điều chỉnh cao của hệ thống xuất khẩu sau các cú sốc ngắn hạn. Điều này cho thấy nếu có các chính sách hỗ trợ hợp lý, chuỗi cung ứng cà phê tại Đắk Lắk có thể phục hồi và thích nghi nhanh chóng. Do vậy, cần đầu tư vào hạ tầng logistics, cảng cạn, và công nghệ truy xuất nguồn gốc nhằm nâng cao năng lực phản ứng của chuỗi cung ứng trước biến động thị trường quốc tế.

Tổng thể, các hàm ý rút ra từ mô hình định lượng không chỉ giúp nâng cao hiệu quả xuất khẩu cà phê địa phương mà còn cung cấp cơ sở khoa học cho việc thiết kế chính sách thương mại, điều hành tỷ giá và phát triển nông nghiệp bền vững trong bối cảnh hội nhập sâu rộng.

## 7. Kết luận

Nghiên cứu này đã cung cấp bằng chứng thực nghiệm rõ ràng về tác động tích cực của Hiệp định Thương mại Tự do Việt Nam - Liên minh châu Âu đối với hoạt động xuất khẩu cà phê của tỉnh Đắk Lắk sang thị trường EU trong giai đoạn 2015 - 2023. Thông qua việc sử dụng mô hình ARDL, kết quả định lượng cho thấy hiệp định có ảnh hưởng đáng kể và có ý nghĩa thống kê trong dài hạn, thể hiện vai trò thiết thực của EVFTA trong việc thúc đẩy dòng chảy thương mại nông sản ở cấp địa phương. Đồng thời, nghiên cứu cũng ghi nhận tầm quan trọng của các biến kinh tế vĩ mô như giá cà phê thế giới và GDP của EU trong việc điều tiết xuất khẩu, qua đó phản ánh mối liên hệ giữa năng lực cung ứng nội tại và điều kiện thị trường đầu cuối.

Tuy nhiên, kết quả cũng chỉ ra rằng tác động của EVFTA mới chủ yếu đến từ kênh cắt giảm thuế quan, tức là lợi ích tức thời từ việc xóa bỏ thuế nhập khẩu, trong khi các yếu tố phi thuế quan như tiêu chuẩn kỹ thuật, tín hiệu thể chế và truy xuất nguồn gốc vẫn là những thách thức lớn đối với doanh nghiệp và chính quyền địa phương. Những hạn chế này xuất phát từ chính năng lực nội tại của tỉnh: hệ thống chế biến chưa sâu, cơ sở hạ tầng truy xuất nguồn gốc chưa được chuẩn hóa theo tiêu chuẩn EU, và đặc biệt là sự phối hợp trong chuỗi giá trị từ nông dân đến doanh nghiệp còn lỏng lẻo và thiếu tính bền vững. Điều này cho thấy rằng lợi ích từ FTA hiện nay mới chỉ dừng lại ở chiều rộng, chưa đạt đến chiều sâu cần thiết để chuyển hóa thành động lực phát triển bền vững và mang tính chiến lược.

Trên cơ sở những phát hiện đó, nghiên cứu nhấn mạnh yêu cầu cần thiết phải thiết kế một hệ sinh thái chính sách mang tính tích hợp và đa tầng, kết nối giữa năng lực thể chế, năng lực công nghệ, và sự tham gia hiệu quả của các chủ thể trong chuỗi giá trị. Điều này bao gồm việc cải thiện hạ tầng chế biến sâu và hệ thống truy xuất nguồn gốc theo chuẩn quốc tế, thúc đẩy hình thành mô

hình liên kết sản xuất theo vùng nguyên liệu có chỉ dẫn địa lý, xây dựng trung tâm hỗ trợ thực thi FTA tại địa phương, và cuối cùng là phát triển chiến lược quốc gia về thương hiệu nông sản bền vững. Chỉ khi các cấp chính quyền, doanh nghiệp và các tổ chức trung gian phối hợp một cách chủ động, có hệ thống và dựa trên dữ liệu thực chứng, EVFTA mới có thể phát huy vai trò như một công cụ chiến lược dài hạn giúp nâng cấp chuỗi giá trị cà phê Việt Nam không chỉ dựa trên lợi thế chi phí, mà còn dựa trên chất lượng, tính bền vững và giá trị thương hiệu quốc gia.

### Tài liệu tham khảo

1. Anderson, J. E., & van Wincoop, E. (2003). Gravity with gravitas: A solution to the border puzzle. *American Economic Review*, 93(1), 170–192. <https://doi.org/10.1257/000282803321455214>
2. European Commission. (2020). *EU–Vietnam Free Trade Agreement: Guide for exporters*. EU Publications.
3. Eurostat. (2023). *Gross domestic product, EU*. <https://ec.europa.eu/eurostat>
4. Giles, D. E. (2011). ARDL models – Part II – bounds tests. *Econometrics Beat: Dave Giles' Blog*. <https://davegiles.blogspot.com/2011/09/ardl-models-part-ii-bounds-tests.html>
5. Hadjinikolov, D., & Zhelev, P. (2018). Expected impact of EU–Vietnam free trade agreement on Bulgaria's exports. *MPRA Paper*, No. 89713. <https://mpra.ub.uni-muenchen.de/89713/>
6. Harris, R., & Sollis, R. (2003). *Applied time series modelling and forecasting*. Wiley, West Sussex.
7. Hoang, N. T., & Ngan, T. T. (2021). Impacts of EVFTA on the exportation of Vietnamese agricultural products to the EU market. *Journal of International Economics and Management*, 21(3), 45–63.
8. ICO. (2023). *Coffee market report*. International Coffee Organization. <https://www.ico.org>
9. ITC Trade Map. (2023). *Vietnam's coffee export to EU – Time series data*. <https://www.trademap.org>
10. Narayan, P. K. (2005). The saving and investment nexus for China: Evidence from cointegration tests. *Applied Economics*, 37(17), 1979–1990. <https://doi.org/10.1080/00036840500278103>
11. Nguyen, T. P., Do, T. H., & Vu, H. T. (2023). Assessing the impacts of the EVFTA on Vietnam's agricultural exports. In *The Vietnam–EU Economic and Trade Forum*. Springer.
12. Nkoro, E., & Uko, A. K. (2016). Autoregressive distributed lag (ARDL) cointegration technique: Application and interpretation. *Journal of Statistical and Econometric Methods*, 5(4), 63–91.
13. Pesaran, M. H., & Shin, Y. (1999). An autoregressive distributed-lag modelling approach to cointegration analysis. In S. Strom (Ed.), *Econometrics and economic theory in the 20th century: The Ragnar Frisch centennial symposium* (pp. 371–413). Cambridge University Press.
14. Pesaran, M. H., Shin, Y., & Smith, R. J. (2001). Bounds testing approaches to the analysis of level relationships. *Journal of Applied Econometrics*, 16(3), 289–326. <https://doi.org/10.1002/jae.616>
15. Tổng cục Thống kê. (2022). *Niên giám thống kê tỉnh Đắk Lắk 2021*. Nxb Thống kê, Hà Nội.
16. Vicofa. (2022). *Báo cáo ngành cà phê Việt Nam 2022*. Hiệp hội Cà phê Ca Cao Việt Nam, Hà Nội.
17. Vu, H. T., Do, T. H., & Nguyen, T. P. (2023). Sustainable standards compliance of Vietnamese agricultural SMEs under EVFTA. *Asia-Pacific Trade Review*, 29(2), 102–120.
18. World Bank. (2020). *Deepening integration and upgrading Vietnam's participation in global value chains*. World Bank, Washington, D.C.