

BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO
TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH

NGUYỄN KHẮC HIẾU

PHÂN TÍCH TÁC ĐỘNG CỦA THIÊN TÀI ĐẾN
TĂNG TRƯỞNG KINH TẾ VÀ LẠM PHÁT
TẠI VIỆT NAM

Chuyên ngành: **Kinh tế phát triển**

Mã số: 62310105

LUẬN ÁN TIẾN SĨ KINH TẾ

TP.HCM, Năm 2017

BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO
TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ THÀNH PHỐ HỒ CHÍ MINH

NGUYỄN KHẮC HIẾU

PHÂN TÍCH TÁC ĐỘNG CỦA THIÊN TÀI ĐẾN
TĂNG TRƯỞNG KINH TẾ VÀ LẠM PHÁT
TẠI VIỆT NAM

Chuyên ngành: **Kinh tế phát triển**

Mã số: 62310105

LUẬN ÁN TIẾN SĨ KINH TẾ

Người Hướng Dẫn Khoa Học:

TS. NGUYỄN HOÀNG BẢO

TS. PHẠM THỊ THU TRÀ

TP.HCM, Năm 2017

LỜI CAM ĐOAN

Tôi cam đoan đây là công trình nghiên cứu do chính tôi thực hiện. Các số liệu thu thập, các kết quả phân tích trong luận án là trung thực và chưa từng được ai công bố trong bất kỳ công trình nào khác.

Nguyễn Khắc Hiếu

LỜI CẢM ƠN

Trong quá trình thực hiện luận án, tôi đã gặp nhiều khó khăn từ việc định hướng nghiên cứu, phương pháp nghiên cứu, thu thập dữ liệu và cả việc làm thế nào để sắp xếp công việc hợp lý để có thời gian thực hiện nghiên cứu. Để vượt qua những khó khăn trên, tôi đã nhận được sự giúp đỡ rất nhiều từ các GVHD, các Thầy Cô đang công tác tại trường Đại học Kinh Tế Tp.HCM cũng như sự động viên từ gia đình và các đồng nghiệp.

Lời đầu tiên, tôi xin chân thành cảm ơn thầy Nguyễn Hoàng Bảo, người đã tận tình hướng dẫn tôi trong luận án này. Thầy đã chỉ ra cho tôi một hướng đi đúng và giúp đỡ tôi vượt qua những khó khăn trên con đường thầy đã định hướng. Thầy cũng đã hướng dẫn tôi từ bố cục đến cách trình bày từng câu từng ý trong luận án này. Tôi cũng xin chân thành cảm ơn cô Phạm Thị Thu Trà, người đã có những góp ý quan trọng giúp tôi hoàn thiện tốt hơn bài viết của mình.

Tôi xin chân thành cảm ơn đến tất cả quý Thầy Cô tại Khoa Kinh Tế, Trường đại học Kinh Tế Tp.HCM đã tạo những điều kiện thuận lợi, một môi trường học thuật tốt để tôi có thể hoàn thành đề tài nghiên cứu của mình. Đặc biệt, tôi xin gửi lời cảm ơn đến thầy Nguyễn Trọng Hoài, Nguyễn Hữu Dũng, Phạm Khánh Nam, Trương Đăng Thụy và thầy Trần Tiến Khai đã có những góp ý giúp tôi hoàn thiện đề cương nghiên cứu cũng như hoàn thiện ba chuyên đề nghiên cứu của mình.

Tôi cũng xin chân thành cảm ơn đến tất cả quý Thầy Cô tại Khoa Kinh Tế, Trường đại học Sư Phạm Kỹ Thuật Tp.HCM. Quý Thầy Cô đã có những góp ý cho luận án đồng thời đã tạo những điều kiện thuận lợi trong công việc để tôi có thể thực hiện tốt nghiên cứu của mình.

Cuối cùng, tôi xin gửi lời cảm ơn đến bố mẹ và vợ con tôi, những người cho tôi một chỗ dựa về mặt tinh thần và động viên tôi những lúc cần thiết để tôi có thể hoàn thành chặng đường đầy chông gai này.

Nguyễn Khắc Hiếu

MỤC LỤC

LỜI CAM ĐOAN	i
LỜI CẢM ƠN	ii
MỤC LỤC.....	iii
DANH MỤC CÁC KÝ HIỆU CÁC TỪ VIẾT TẮT.....	x
DANH MỤC CÁC BẢNG.....	xi
DANH MỤC CÁC HÌNH VẼ.....	xii
TÓM TẮT LUẬN ÁN	xiv
Chương 1: TỔNG QUAN ĐỀ TÀI.....	1
1.1 Bối cảnh nghiên cứu.....	1
1.1.1 Bối cảnh thực tiễn	1
1.1.2 Bối cảnh lý thuyết	4
1.2 Mục tiêu nghiên cứu.....	8
1.3 Câu hỏi nghiên cứu	9
1.4 Đối tượng và phạm vi nghiên cứu.....	9
1.5 Phương pháp nghiên cứu và dữ liệu.....	10
1.6 Ý nghĩa đề tài	12
1.7 Bố cục luận án.....	13
Chương 2: CƠ SỞ LÝ THUYẾT.....	17
2.1 Các khái niệm liên quan.....	17
2.1.1 Thiên tai và những tác động do thiên tai.....	17
2.1.2 Tăng trưởng kinh tế.....	19
2.1.3 Lạm phát.....	21

2.1.4 Thu nhập bình quân đầu người	22
2.2 Mô hình Solow và tác động của thiên tai trong dài hạn.....	23
2.3 Mô hình tổng cung-tổng cầu	26
2.3.1 Đường tổng cầu	26
2.3.2 Đường tổng cung.....	28
2.3.3 Phân tích tác động của thiên tai bằng mô hình tổng cung-tổng cầu	30
2.4 Mô hình IB-EB.....	33
2.4.1 Trạng thái cân bằng.....	34
2.4.2 Tác động của thiên tai đến trạng thái cân bằng.....	36
2.5 Các nghiên cứu thực nghiệm liên quan.....	38
2.5.1 Tác động thiên tai đến tăng trưởng kinh tế	38
2.5.2 Tác động thiên tai đến giá cả hàng hóa	44
2.5.3 Tác động thiên tai đến thu nhập và chi tiêu hộ gia đình	44
2.5.4 Tác động thiên tai đến một số biến số kinh tế, xã hội khác	47
2.6 Tóm tắt chương	51
Chương 3: PHƯƠNG PHÁP NGHIÊN CỨU	52
3.1 Phương pháp tự hồi quy vector có cấu trúc (SVAR)	52
3.1.1 Mô hình toán	54
3.1.2 Vấn đề xác định trong SVAR	58
3.2 Phương pháp Synthetic Control	61
3.2.1 Giới thiệu phương pháp Synthetic Control	62
3.2.2 Mô hình hóa phương pháp Synthetic Control.....	64
3.2.3 Kiểm định ý nghĩa thống kê của ước lượng	67

3.3 Tóm tắt chương	68
Chương 4: TÁC ĐỘNG CỦA THIÊN TAI ĐẾN TĂNG TRƯỞNG KINH TẾ.....	70
4.1 Mô hình nghiên cứu và dữ liệu nghiên cứu	70
4.1.1 Mô hình nghiên cứu	70
4.1.2 Dữ liệu nghiên cứu.....	73
4.2 Kết quả nghiên cứu	76
4.2.1 Kiểm tra tính dừng của dữ liệu	76
4.2.2 Ước lượng và kiểm định mô hình	77
4.2.3 Kiểm định nhân quả Granger	78
4.2.4 Phân tích hàm phản ứng xung.....	79
4.2.5 Phân tích phân rã phương sai.	81
4.2.6 Kiểm tra tính vững (Robustness) của mô hình	82
4.3 Thảo luận kết quả nghiên cứu	85
4.4 Tóm tắt chương	87
Chương 5: TÁC ĐỘNG CỦA THIÊN TAI ĐẾN LẠM PHÁT	88
5.1 Tác động của thiên tai đến mức giá từ mô hình tổng cung-tổng cầu.....	88
5.1.1 Các yếu tố tác động đến mức giá	88
5.1.2 Tác động của thiên tai đến mức giá	89
5.2 Mô hình nghiên cứu và dữ liệu nghiên cứu	91
5.2.1 Mô hình nghiên cứu	91
5.2.2 Dữ liệu nghiên cứu.....	92
5.3 Kết quả nghiên cứu	95
5.3.1 Tác động của thiên tai đến giá cả hàng hóa nói chung	95

5.3.2 Tác động của thiên tai đến giá cả các loại hàng hóa khác nhau.....	101
5.4 Thảo luận kết quả nghiên cứu	103
5.5 Tóm tắt chương	106
Chương 6: TÁC ĐỘNG CỦA THIÊN TAI ĐẾN THU NHẬP BÌNH QUÂN ĐẦU NGƯỜI.....	107
6.1 Mô hình nghiên cứu và dữ liệu nghiên cứu	107
6.1.1 Lựa chọn tình huống nghiên cứu và nhóm kiểm soát	108
6.1.2 Mô hình nghiên cứu	110
6.1.3 Dữ liệu nghiên cứu.....	112
6.2 Kết quả nghiên cứu	116
6.2.1 Tác động của bão Durian đến thu nhập bình quân đầu người	116
6.2.2 Tác động của bão Durian đến các thành phần của thu nhập đầu người.120	
6.2.2.1 Tác động của bão Durian đến thu nhập nông-lâm-ngư nghiệp.....	120
6.2.2.2 Tác động của bão Durian đến thu nhập từ lương.....	123
6.2.2.3 Tác động bão Durian đến thu nhập từ công nghiệp, xây dựng, thương mại và dịch vụ	124
6.3 Thảo luận kết quả nghiên cứu	125
6.4 Tóm tắt chương	126
Chương 7: KẾT LUẬN.....	128
7.1 Tóm lược phương pháp và dữ liệu nghiên cứu	128
7.2 Những phát hiện của đề tài.....	129
7.3 Những hàm ý chính sách.....	130
7.3.1 Những chính sách vĩ mô	131
7.3.2 Những chính sách cứu trợ sau thiên tai.....	132

7.4 Hạn chế và hướng nghiên cứu tiếp theo.....	134
DANH MỤC CÁC CÔNG TRÌNH CỦA TÁC GIẢ.....	136
TÀI LIỆU THAM KHẢO TIẾNG VIỆT	137
TÀI LIỆU THAM KHẢO TIẾNG ANH.....	139
PHỤ LỤC.....	147
Phụ lục 1.1: Tần số xuất hiện của thiên tai tại Việt Nam từ 1989-2016.....	147
Phụ lục 1.2: Thiệt hại về người do thiên tai tại Việt Nam từ 1989-2016.....	148
Phụ lục 1.3: Thiệt hại về tài sản do thiên tai tại Việt Nam từ 1989-2016.....	149
Phụ lục 1.4: Tần số xuất hiện của thiên tai theo khu vực địa lý	150
Phụ lục 1.5: Số người chết và số nhà cửa bị phá hủy do thiên tai theo khu vực địa lý.....	153
Phụ lục 1.6: Tần số xuất hiện của các loại thiên tai khác nhau.....	154
Phụ lục 2.1: Đường IS.....	155
Phụ lục 2.2: Đường LM	155
Phụ lục 4.1: Tăng trưởng kinh tế Việt Nam giai đoạn 2004Q1-2016Q2.....	156
Phụ lục 4.2: Thiệt hại về người và tài sản giai đoạn 2004Q1-2016Q2.....	157
Phụ lục 4.3: Kiểm định tính dừng	158
Phụ lục 4.4: Các tiêu chí lựa chọn độ trễ cho mô hình	158
Phụ lục 4.5: Kết quả ước lượng mô hình SVAR.....	159
Phụ lục 4.6: Kiểm định phần dư tuân theo phân phối chuẩn	161
Phụ lục 4.7: Kiểm định hiện tượng tự tương quan.....	161
Phụ lục 4.8: Kiểm định phương sai sai số thay đổi.....	162
Phụ lục 4.9: Phân phối thiệt hại tài sản do thiên tai từ 2004Q1-2016Q2	163

Phụ lục 5.1: Thiệt hại do thiên tai giai đoạn 2004T1-2014T12	164
Phụ lục 5.2: Lạm phát Việt Nam giai đoạn 2004T1-2014T12	164
Phụ lục 5.3: Kiểm định tính dừng	165
Phụ lục 5.4: Các tiêu chí lựa chọn độ trễ cho mô hình	165
Phụ lục 5.5: Mô hình SVAR phân tích tác động của thiên tai đến lạm phát	166
Phụ lục 5.6: Kiểm định hiện tượng tự tương quan.....	168
Phụ lục 5.7: Kiểm định phương sai thay đổi với biến phụ thuộc lạm phát.....	169
Phụ lục 5.8: Kiểm định phương sai thay đổi với biến phụ thuộc thiệt hại tài sản	170
Phụ lục 5.9: Kiểm định phương sai thay đổi với biến phụ thuộc giá dầu.....	171
Phụ lục 5.10: Kiểm định phương sai thay đổi với biến phụ thuộc cung tiền.....	172
Phụ lục 5.11: Kiểm định phương sai thay đổi với biến phụ thuộc tỷ giá.....	173
Phụ lục 5.12: Ma trận A và B khi xác định cấu trúc mô hình VAR	174
Phụ lục 5.13: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả lương thực, thực phẩm.....	175
Phụ lục 5.14: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả đồ uống, thuốc lá	176
Phụ lục 5.15: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả nhà ở và vật liệu xây dựng	177
Phụ lục 5.16: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả y tế, dược phẩm	178
Phụ lục 5.17: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả giáo dục	179
Phụ lục 5.18: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả du lịch, giải trí	180
Phụ lục 5.19: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả hàng may mặc.....	181
Phụ lục 5.20: Ảnh hưởng thiên tai đến giá cả thiết bị gia đình.....	182
Phụ lục 5.21: Ma trận A, B khi ước lượng với biến FOOD-PRICE	184
Phụ lục 5.22: Ma trận A,B khi ước lượng với biến HOUSE-PRICE.....	185