

PGS.TS. ĐÌNH PHI HỒ

NGHIÊN CỨU ĐỊNH LƯỢNG

TRONG KINH TẾ & VIẾT BÀI BÁO KHOA HỌC

SÁCH KÈM



CD



NHÀ XUẤT BẢN TÀI CHÍNH

NGHIÊN CỨU ĐỊNH LƯỢNG
TRONG KINH TẾ & VIẾT BÀI BÁO KHOA HỌC

***Tác giả xin dâng tặng cuốn sách này cho đồng sinh
thành đã tận tụy cả đời cho con (Ông Đình Khôi và Bà
Trần Thị Vân).***

LỜI GIỚI THIỆU

PGS.TS. Đinh Phi Hổ, tác giả cuốn sách “Nghiên cứu định lượng trong kinh tế và viết bài báo khoa học”, là người có kinh nghiệm trong giảng dạy và nghiên cứu những vấn đề kinh tế. Tác giả đã có nhiều sách, bài báo được công bố trên các tạp chí trong và ngoài nước liên quan đến những chủ đề trên. Trong những năm gần đây, để nâng cao chất lượng nghiên cứu và công bố kết quả nghiên cứu khoa học theo thông lệ quốc tế, các chương trình đào tạo sau đại học đòi hỏi học viên quan tâm nhiều hơn đến phương pháp nghiên cứu khoa học và chất lượng của luận án (luận văn Thạc sĩ và luận án Tiến sĩ) tốt nghiệp. Trong thực tiễn ở Việt Nam, khi viết luận án và báo cáo nghiên cứu, mặc dù có sự nỗ lực rất lớn, nhiều học viên, nghiên cứu sinh và nhà nghiên cứu vẫn cảm thấy bối rối và gặp nhiều khó khăn trong việc vận dụng các phương pháp nghiên cứu khoa học, nhất là áp dụng các công cụ phân tích thống kê và kinh tế lượng vào nghiên cứu. Chính vì thế, kết quả nghiên cứu chưa đáp ứng chuẩn mực khoa học cũng như chưa vận dụng và thể hiện kết quả nghiên cứu một cách khoa học.

Từ kinh nghiệm qua nhiều năm tích lũy, cũng như qua việc tham khảo các tài liệu quốc tế và các kết quả nghiên cứu thực nghiệm gần đây tại Việt Nam, tác giả đã đúc kết các vấn đề để hình thành cuốn sách chuyên khảo có tựa là *Nghiên cứu định lượng trong kinh tế và viết bài báo khoa học*. Trong tác phẩm này, người đọc sẽ hiểu rõ bản chất của các nguyên tắc thống kê, kinh tế lượng và ứng dụng vào trong lĩnh vực kinh tế: Kinh tế học, Kinh doanh, Tài chính - Ngân hàng, Kế toán - kiểm toán, Quản trị - quản lý, biết cách sử dụng các kiểm định thống kê, mô hình kinh tế lượng và kỹ năng khi sử dụng công cụ phân tích trong nghiên cứu, nhất là việc sử dụng phần mềm SPSS, EVIEWS và AMOS trong phân tích.

Tại Việt Nam, hiện chưa có nhiều sách viết về ứng dụng thống kê và kinh tế lượng trong lĩnh vực kinh tế. Có thể nói đây là một trong những cuốn sách tham khảo có ý nghĩa viết theo cách tiếp cận mới trong ứng dụng: (i) Không đi sâu vào chứng minh thống kê, kinh tế lượng mà là làm rõ các nguyên lý, nguyên tắc thống kê - kinh tế lượng nhằm sử dụng chúng vào ứng dụng trong thực tiễn nghiên cứu, đặc biệt là có nguồn trích dẫn rõ ràng, tin cậy; (ii) Mỗi chương được thể hiện kết hợp: lý thuyết, tình huống ứng dụng với dữ liệu thực tiễn trong lĩnh vực kinh tế và gợi ý đáp án; (iii) Xuyên suốt cuốn sách hướng dẫn sử dụng 3 phần mềm (SPSS; EVIEWS và AMOS) với hướng dẫn rõ ràng, bạn đọc có thể tự chính mình áp dụng.

Bố cục các chương mục của cuốn sách với trình tự logic chặt chẽ vừa mang tính hàn lâm, vừa mang tính thực tiễn. Nội dung cuốn sách vừa thể hiện những vấn đề cơ bản, nền tảng của phương pháp thống kê, kinh tế lượng vừa thể hiện tính triết lý khoa học và các khả năng ứng dụng thực tiễn của các phương pháp nghiên cứu hiện đại. Với sự mới mẻ, chặt chẽ về cách

nguyên cứu khi thực hiện nghiên cứu: (1) Cách tiếp cận xác định cỡ mẫu; (2) phương pháp chọn mẫu ngẫu nhiên và phi ngẫu nhiên, cùng với các kỹ thuật lấy mẫu tương ứng với phương pháp chọn mẫu. Năm bắt được những kiến thức cơ bản trên sẽ rất hữu ích cho người đọc là học viên thạc sĩ và nghiên cứu sinh tiến sĩ, nhà nghiên cứu trong ứng dụng bước đầu lựa chọn luận án, đề tài nghiên cứu của mình trong lĩnh vực Kinh tế.

Chương 2: Kiểm định giả thuyết nghiên cứu

Chương này tập trung vào các công cụ giúp chúng ta kiểm định một giả thuyết nghiên cứu đưa ra. Ứng dụng 3 loại kiểm định giả thuyết nghiên cứu chủ yếu thường sử dụng: (i) Kiểm định Chi bình phương; (ii) Kiểm định t đối với mẫu độc lập và (iii) Phân tích phương sai một yếu tố.

Chương 3: Kiểm định phi tham số

Chương này tập trung vào các công cụ giúp chúng ta kiểm định một giả thuyết nghiên cứu trong trường hợp mẫu khảo sát nhỏ. Kiểm định phi tham số rất hữu ích cho nghiên cứu vì trong thực tiễn, dữ liệu thu thập thường không đáp ứng yêu cầu khắc khe của kiểm định tham số là phải đảm bảo dữ liệu có phân phối chuẩn và những nghiên cứu có mẫu khảo sát nhỏ. Hơn nữa, kiểm định phi tham số có thể dùng được cho nhiều loại biến chứ không riêng gì biến định lượng. Nội dung chương này tập trung vào 3 loại kiểm định phi tham số chủ yếu thường sử dụng: (i) Kiểm định dấu hoặc kiểm định dấu và hạng Wilcoxon; (ii) Kiểm định Mann-Whitney và (iii) Kiểm định Kruskal-Wallis.

Phần 2: ỨNG DỤNG MÔ HÌNH KINH TẾ LƯỢNG

Phần này bao gồm 5 chương, trang bị kiến thức về cách tiếp cận và ứng dụng các mô hình kinh tế lượng vào nghiên cứu kinh tế. Các mô hình được hướng dẫn sử dụng các phần mềm SPSS, EVIEWS, AMOS cho phân tích.

Chương 4: Ứng dụng mô hình hồi quy tuyến tính.

Chương này trang bị kiến thức nền tảng của kinh tế lượng và ứng dụng mô hình hồi quy tuyến tính vào lĩnh vực kinh tế với 5 nghiên cứu: (i) Yếu tố ảnh hưởng đến tăng trưởng kinh tế; (ii) Các yếu tố ảnh hưởng đến hiệu quả kinh doanh của doanh nghiệp nhỏ và vừa (iii) Kiến thức nông nghiệp ảnh hưởng tới thu nhập của nông dân; (iv) Các yếu tố ảnh hưởng đến chất lượng thông tin kế toán trong báo cáo tài chính (BCTC) của các doanh nghiệp; (v) Tác động của tín dụng vi mô đối với thu nhập của các hộ nghèo.

Chương 5: Ứng dụng mô hình hồi quy Binari Logistic.

Mô hình quy Binary Logistic là một dạng đặc biệt của mô hình hồi quy tuyến tính khi biến phụ thuộc là dạng biến giả. Chương này, mô hình hồi quy Binary Logistic được ứng dụng vào lĩnh vực kinh tế với 7 nghiên cứu: (i) Đo lường nghèo đa chiều và các yếu tố ảnh hưởng; (ii) Các yếu tố ảnh hưởng đến hành vi lựa chọn ứng dụng các biện pháp sản xuất nông nghiệp bền

vững của nông hộ; (iii) Các yếu tố ảnh hưởng đến tiếp cận vốn vay của doanh nghiệp nhỏ và vừa; (iv) Các yếu tố ảnh hưởng đến thay đổi thu nhập của người dân bị thu hồi đất cho phát triển các khu công nghiệp; (v) Các yếu tố ảnh hưởng đến quyết định tham gia mô hình Cánh đồng lớn của nông dân; (vi) Các yếu tố ảnh hưởng đến quyết định lựa chọn dịch vụ kế toán của các doanh nghiệp nhỏ và vừa; (vii) Các yếu tố ảnh hưởng đến quyết định áp dụng chuẩn mực kế toán (CMKT) của các doanh nghiệp nhỏ và vừa.

Chương 6: Ứng dụng mô hình hồi quy dữ liệu bảng.

Mô hình hồi quy dữ liệu bảng là một dạng đặc biệt của mô hình hồi quy tuyến tính khi dữ liệu thay đổi theo thời gian và không gian. Chương này, mô hình hồi quy dữ liệu bảng được ứng dụng vào vào lĩnh vực kinh tế với 4 nghiên cứu: i) Các yếu tố ảnh hưởng đến việc làm của người lao động; (ii) Tác động của cấu trúc sở hữu đến quyết định đòn bẩy tài chính của các doanh nghiệp; (iii) Nâng cao chất lượng thông tin kế toán trong báo cáo tài chính của các doanh nghiệp nhỏ và vừa; (iv) Tác động của thông tin kế toán đến giá cổ phiếu.

Chương 7: Ứng dụng mô hình phân tích nhân tố khám phá.

Mô hình phân tích nhân tố khám phá thích hợp trong trường hợp khi các biến độc lập và phụ thuộc được đo lường bởi thang đo, đặc biệt là nhận dạng bộ thang đo. Chương này, mô hình phân tích nhân tố khám phá được ứng dụng trong lĩnh vực kinh tế với 6 nghiên cứu: (i) Sự hài lòng của dân cư về sự thay đổi chất lượng cuộc sống và thu nhập do tác động khu công nghiệp; (ii) Sự hài lòng của các doanh nghiệp có vốn đầu tư trực tiếp nước ngoài đối với chất lượng dịch vụ hỗ trợ thuế; (iii) Hài lòng của nông dân đối với các lớp huấn luyện trong nông nghiệp của trung tâm khuyến nông; (iv) Đo lường chất lượng dịch vụ hành chính công và sự hài lòng của người dân; (v) Sự hài lòng khách hàng đối với chất lượng dịch vụ của Khách sạn; (vi) Mức độ áp dụng chuẩn mực kế toán tác động đến lợi ích cho các doanh nghiệp nhỏ và vừa.

Chương 8: Ứng dụng mô hình phân tích cấu trúc tuyến tính.

Mô hình cấu trúc tuyến tính là mở rộng của mô hình phân tích nhân tố khám phá khi các biến trong mô hình xuất hiện trường hợp một biến nào đó là biến độc lập, đồng thời lại là biến phụ thuộc, mối hệ tương quan giữa các biến trở nên phức hợp. Chương này, mô hình phân tích cấu trúc tuyến tính được ứng dụng trong lĩnh vực kinh tế với 6 nghiên cứu: : (i) Tác động của chất lượng dịch vụ đến lòng trung thành của khách hàng sử dụng dịch vụ khách sạn 4 - 5 sao; (ii) Mối quan hệ giữa sự hài lòng về chất lượng dịch vụ, hình ảnh thương hiệu và ý định mua; (iii) Tác động năng lực lãnh đạo đến kết quả kinh doanh của doanh nghiệp nhỏ và vừa; (iv) Mối quan hệ giữa chất lượng dịch vụ hành chính công, hình ảnh, hài lòng và tín nhiệm của người dân; (v) Lợi ích của doanh nghiệp nhỏ và vừa đối với áp dụng chuẩn mực kế toán; (vi) Tác động của mức độ thuê dịch vụ kiểm toán đến lợi ích doanh nghiệp.

Nội dung mỗi chương ứng dụng mô hình kinh tế lượng tập trung vào 3 phần: (1) Mô hình

lý thuyết của nghiên cứu; (2) Phân tích mô hình dựa trên các phần mềm thích hợp; và (3) Để cho bạn đọc tự nghiên cứu, cuối chương có tình huống với dữ liệu áp dụng (trong đĩa CD kèm theo sách) và phần Phụ lục có gợi ý đáp án để bạn đọc kiểm tra kết quả.

Phần 3: BÀI BÁO KHOA HỌC

Phần này bao gồm chương 9 và phụ lục 21 bài báo của tác giả đã công bố trên các tạp chí hàng đầu trong nước (Tạp chí Phát triển kinh tế; Kinh tế và Phát triển; Nghiên cứu kinh tế...) và quốc tế (Scopus, ISI, ABCD, ESCI, ACI).

Chương 9: CÁCH TRÌNH BÀY MỘT BÀI BÁO KHOA HỌC KINH TẾ

Nội dung chương này tập trung vào: (i) Hình thức và nội dung của một bài báo khoa học; và (ii) Cách trích nguồn tài liệu tham khảo; (iii) Phụ lục các bài báo khoa học công bố trong nước và quốc tế của tác giả.

Trong sách này, các tác giả sử dụng 3 phần mềm: SPSS phiên bản 20.0; Eviews phiên bản 8.1 và AMOS phiên bản 20.0. Cần nhấn mạnh rằng cuốn sách này không đi sâu vào việc chứng minh các nguyên lý, kiểm định của thống kê và kinh tế lượng mà tập trung vào việc ứng dụng chúng trong phân tích kết quả của mô hình nghiên cứu.

Trong quá trình biên soạn, tác giả đã có nhiều cố gắng song không thể tránh khỏi thiếu sót, rất mong nhận được ý kiến đóng góp của quý bạn đọc.

Mọi ý kiến của bạn đọc xin gửi cho các tác giả theo địa chỉ:

PGS.TS. Đinh Phi Hồ; Email: dingphiho@gmail.com.

Thành phố Hồ Chí Minh, ngày 17 tháng 4 năm 2019

Tác giả

ĐINH PHI HỒ

LỜI CẢM ƠN

Tác giả trân trọng cảm ơn các đồng nghiệp đã cùng tham gia thực hiện các công trình nghiên cứu khoa học, đồng tác giả các bài báo khoa học, cung cấp dữ liệu, kinh nghiệm giảng dạy môn Phương pháp nghiên cứu khoa học và nghiên cứu định lượng trong kinh tế, và góp ý cho nội dung của cuốn sách này.

Những kết quả nghiên cứu được trình bày trong sách này có được là nhờ sự giúp đỡ và hỗ trợ của rất nhiều đồng nghiệp trường ĐH Kinh tế TP.HCM, cựu sinh viên cao học và nghiên cứu sinh ĐH Kinh tế TP.HCM, ĐH Phan Thiết.

Tác giả xin trân trọng biết ơn những đóng góp của GS.TS. Nguyễn Trọng Hoài (ĐH Kinh tế TP.HCM), PGS.TS. Nguyễn Văn Phương (ĐH Quốc Tế - ĐH Quốc Gia TP.HCM), PGS. TS. Võ Khắc Thường (ĐH Phan Thiết), Th.S Hoàng Đức Kiên Thế, Th.S Nguyễn Hữu Cần đã động viên và khuyến khích tác giả hoàn thành cuốn sách này.

Tác giả xin trân trọng cảm ơn TS. Phạm Ngọc Dương; TS. Nguyễn Viết Bằng; TS. Phan Thanh Long; TS. Huỳnh Thế Nguyễn; Th.S Huỳnh Đình Phát; Th.S Lê Quốc Nghi; Th.S Nguyễn Anh Tuấn, Nguyễn Mạnh Hùng, Nguyễn Thọ Chân, Bùi Hồng Minh, Nguyễn Ngọc Hoàng, Nguyễn Minh Đức, Đặng Hồng Sỹ, Đặng Văn Công, Tạ Minh Khôi, Trần Thị Hồng Hải, Nguyễn Đình Duy và Võ Lý Hoài Vũ đã động viên, khuyến khích tác giả và góp phần tài trợ cho xuất bản cuốn sách này.

Tác giả xin chân thành cảm ơn ông Nguyễn Văn Hiếu, GD Công ty TM.DV. Hương Huy (Nhà sách Kinh Tế, TP.HCM), người đã động viên, ủng hộ cả tấm lòng cũng như vật chất cho cuốn sách này được ra đời.

Tác giả

PGS.TS. Đinh Phi Hổ

.....

MỤC LỤC

LỜI GIỚI THIỆU	v
LỜI NÓI ĐẦU	vii
LỜI CẢM ƠN	xi
PHẦN 1: TIẾP CẬN NGHIÊN CỨU VÀ THỐNG KÊ	1
CHƯƠNG 1: TỔNG QUAN VỀ PHƯƠNG PHÁP NGHIÊN CỨU TRONG KINH TẾ	1
1.1 Cách Tiếp Cận Nghiên Cứu	2
1.1.1 Suy Diễn Và Quy Nạp	2
1.1.2 Định Tính, Định Lượng Và Hỗn Hợp	4
1.2 Phương Pháp Nghiên Cứu	8
1.2.1. Nghiên Cứu	8
1.2.2. Nghiên Cứu Kinh Tế	8
1.3 Đề Tài Nghiên Cứu Khoa Học Và Luận Án Nghiên Cứu	10
1.3.1 Các Khái Niệm	10
1.3.2 Quan Hệ Giữa Đề Tài Nghiên Cứu Khoa Học Và Luận Án Nghiên Cứu	10
1.4 Điều Tra Chọn Mẫu Và Phương Pháp Chọn Mẫu	12
1.4.1 Khái Niệm Mẫu	
1.5 Các Tình Huống	20
1.5.1 Tình Huống 1	20
1.5.2 Tình Huống 2	21
1.5.3 Tình Huống 3	21
Phụ Lục: Đáp Án Tình Huống	21
Tài Liệu Tham Khảo	23
CHƯƠNG 2: KIỂM ĐỊNH GIẢ THUYẾT NGHIÊN CỨU	25
2.1 Một Số Khái Niệm	26
2.1.1 Tham Số	26
2.1.2 Biến Số	26
2.1.3 Thang Đo	26
2.2 Kiểm Định Giả Thuyết	28

2.2.1 Ý Nghĩa	28
2.2.2 Khái Niệm Về Giả Thuyết	28
2.2.3 Nguyên Tắc Kiểm Định	29
2.3 Kiểm Định Chi Bình Phương	32
2.3.1 Mô Hình Ứng Dụng	32
2.3.2 Phân Tích Mô Hình Kiểm Định Dựa Trên Chương Trình SPSS	33
2.4 Kiểm Định T Đối Với Mẫu Độc Lập	37
2.4.1 Nguyên tắc	37
2.4.2 Mô hình ứng dụng	38
2.5 Phân Tích Phương Sai Một Yếu Tố	40
2.5.1 Cơ sở lý thuyết	40
2.5.2 Mô hình ứng dụng	41
2.6 Tình Huống Ứng Dụng	45
2.6.1 Tình Huống 1	45
2.6.2 Tình Huống 2	45
2.6.3 Tình Huống 3	46
2.6.4 Tình Huống 4	47
2.6.5 Tình Huống 5	48
Phụ Lục: Đáp Án Tình Huống	49
Tài Liệu Tham Khảo	58

CHƯƠNG 3: KIỂM ĐỊNH PHI THAM SỐ **59**

3.1 Một Số Khái Niệm	60
3.2 Kiểm Định Dấu	60
3.2.1 Nguyên Tắc	60
3.2.2 Giả Thuyết	61
3.2.3 Quy Trình Thực Hiện Kiểm Định Dấu	62
3.3 Kiểm Định Dấu - Hạng WILCOXON	66
3.3.1 Nguyên Tắc	66
3.3.2 Giả Thuyết	66
3.3.3 Quy Trình Thực Hiện Kiểm Định Dấu - Hạng	67
3.4 Kiểm Định MANN-WHITNEY	71
3.4.1 Nguyên Tắc	71

3.4.2 Giả Thuyết	72
3.5 Kiểm Định KRUSKAL-WALLIS	76
3.5.1 Nguyên Tắc	76
3.5.2 Giả Thuyết	76
3.5.2 Quy Trình Thực Hiện Kiểm Định KRUSKAL-WALLIS	77
3.6 Tình Hướng Ứng Dụng	81
3.6.1 Tình Hướng 1	81
3.6.2 Tình Hướng 2	82
3.6.3 Tình Hướng 3	82
3.6.4 Tình Hướng 4	83
Phụ Lục: Đáp Án Tình Hướng	84
Tài Liệu Tham Khảo	86
PHẦN 2: ỨNG DỤNG MÔ HÌNH KINH TẾ LƯỢNG	87
CHƯƠNG 4: ỨNG DỤNG MÔ HÌNH HỒI QUY TUYẾN TÍNH	87
4.1 Mô Hình 1	
CÁC YẾU TỐ ẢNH HƯỞNG ĐẾN TỐC ĐỘ TĂNG TRƯỞNG GDP	88
4.1.1 Cơ Sở Lý Thuyết Của Mô Hình	88
4.1.2 Phân Tích Hồi Quy Dựa Trên Chương Trình SPSS	91
4.2 Mô Hình 2	
CÁC YẾU TỐ ẢNH HƯỞNG ĐẾN HIỆU QUẢ KINH DOANH CỦA DOANH NGHIỆP NHỎ VÀ VỪA (DNVV).	102
4.2.1 Mô Hình Nghiên Cứu	102
4.2.2 Phân Tích Hồi Quy Dựa Trên Chương Trình SPSS	104
4.3 Tình Hướng Ứng Dụng	112
4.3.1 Tình Hướng 1	112
4.3.2 Tình Hướng 2	115
4.3.3 Tình Hướng 3	117
Phụ Lục: Đáp Án Tình Hướng	150
Tài Liệu Tham Khảo	134
CHƯƠNG 5: ỨNG DỤNG MÔ HÌNH HỒI QUY BINARY LOGISTIC	141
5.1 Mô Hình 1	
ĐO LƯỜNG NGHÈO ĐA CHIỀU VÀ CÁC YẾU TỐ ẢNH HƯỞNG	142

5.1.1 Cơ Sở Lý Thuyết	142
5.1.2 Sử Dụng SPSS Đo Lường Nghèo Đa Chiều Và Phân Tích Mô Hình Hồi Quy LOGISTIC	151
5.1.3 Mô Hình Các Yếu Tố Ảnh Hưởng Đến Nghèo Đa Chiều	159
5.2 Mô Hình 2	
CÁC YẾU TỐ ẢNH HƯỞNG ĐẾN HÀNH VI LỰA CHỌN ỨNG DỤNG CÁC BIỆN PHÁP SẢN XUẤT NÔNG NGHIỆP BỀN VỮNG CỦA NÔNG HỘ	168
5.2.1 Cơ Sở Lý Thuyết	168
5.2.2 Hướng Dẫn Sử Dụng SPSS Đo Lường Hàm LOGIT	171
5.2.3 Mô Hình Dự Báo	175
5.3 Tình Huống Ứng Dụng	178
5.3.1 Tình Huống 1	178
5.3.2 Tình Huống 2	181
5.3.3 Tình Huống 3	183
5.3.4 Tình Huống 4	185
5.3.5 Tình Huống 5	186
Phụ Lục: Đáp Án Tình Huống	188
Tài Liệu Tham Khảo	196

CHƯƠNG 6: ỨNG DỤNG MÔ HÌNH HỒI QUY DỮ LIỆU BẢNG 205

6.1 Mô Hình Nghiên Cứu 1: Mở Rộng Việc Làm	206
6.1.1 Cơ Sở Lý Thuyết	206
6.1.2 Mô Hình Hồi Quy Dữ Liệu Bảng	612
6.1.3 Sử Dụng EVIEWS Phân Tích Mô Hình Hồi Quy Dữ Liệu Bảng	214
6.2 Mô Hình Nghiên Cứu 2	229
TÁC ĐỘNG CỦA CẤU TRÚC SỞ HỮU ĐẾN QUYẾT ĐỊNH ĐÒN BẮY TÀI CHÍNH CỦA CÁC DOANH NGHIỆP.	
6.2.1 Cơ Sở Lý Thuyết	229
6.2.2 Hướng Dẫn Sử Dụng EVIEWS	230
6.2.3 Thảo Luận Kết Quả Hồi Quy	241
6.3 Tình Huống Ứng Dụng	243
6.3.1 Tình Huống 1	243
6.3.2 Tình Huống 2	246
Phụ Lục: Đáp Án Tình Huống	247