

# Tác động của tham nhũng đến tăng trưởng kinh tế: Vai trò của chất lượng thể chế

Đặng Văn Cường\*

Ngày nhận: 14/7/2015

Ngày nhận bản sửa: 27/01/2016

Ngày duyệt đăng: 25/5/2016

## Tóm tắt:

Các nghiên cứu trước đây về tác động của tham nhũng lên tăng trưởng xem chất lượng thể chế như là biến kiểm soát. Bên cạnh đó, chất lượng thể chế kinh tế cũng chưa được quan tâm nhiều trong các nghiên cứu này. Bài viết này xem xét vai trò của chất lượng thể chế bao gồm thể chế chính trị (nền dân chủ) và thể chế kinh tế (tự do kinh tế) trong mối quan hệ tham nhũng và tăng trưởng bằng cách đưa vào mô hình biến tương tác giữa tham nhũng và chất lượng thể chế. Để đánh giá hệ số hồi quy các biến trong mô hình, nghiên cứu sử dụng phương pháp ước lượng bình phương tối thiểu tổng quát (GLS) và phương pháp GMM sai phân dành cho dữ liệu bảng. Kết quả cho thấy tham nhũng gây cản trở cho tăng trưởng. Tuy nhiên, biến tương tác thể hiện vai trò tích cực của tham nhũng đối với tăng trưởng trong điều kiện chất lượng thể chế thấp tại các quốc gia khảo sát.

**Từ khóa:** Tham nhũng; chất lượng thể chế; tăng trưởng; GLS; GMM.

## The effect of corruption on economic growth: The role of institutional quality

### Abstract:

The previous studies of the impact of corruption on growth only treat institutional quality as control variables. Moreover, the quality of economic institution has received only modest attention. This paper examines the role of institution quality including political institution (democracy) and economic institution (economic freedom) in the relationship between corruption and economic growth by adding the interaction terms to the model. The paper uses the generalized least square estimation and difference GMM method for panel to obtain the coefficients of these regressors. The results indicate that corruption tends to hamper growth. However, the interaction terms demonstrate that corruption has a positive impact on the economic growth when the quality of institution is very low in the studied countries.

**Keywords:** Corruption; institutional quality; growth; GLS; GMM.

## 1. Giới thiệu

Trong các nghiên cứu lý thuyết lựa chọn công, lý thuyết về tệ quan liêu đã được giới học giả quan tâm và khởi nguồn từ các nghiên cứu của Tullock (1965) và Niskanen (1974). Các nghiên cứu này cũng đã đóng góp vào khung lý thuyết kinh tế thuật ngữ “trục lợi” (rent-seeking). Thuật ngữ này đề cập đến những nỗ lực của các thể lực chính trị tìm cách trục

lợi thông qua các ảnh hưởng của họ đến nền thể chế và qua đó làm giảm hiệu quả của nền thể chế (Tullock, 1967). Hành vi này được xem là hoạt động tham nhũng. Từ đó, hiện tượng tham nhũng trở thành chủ đề thu hút nhiều sự quan tâm của giới học giả và cũng là vấn đề gây nhiều tranh cãi về phương diện đạo đức cũng như ảnh hưởng kinh tế.

Theo Choe & cộng sự (2013), khi khu vực tư và

khu vực công tương tác nhau, giới công chức luôn sẵn sàng làm dụng chức vụ, quyền lực chính trị của mình để tham nhũng. Hành động này được cho là gây trở ngại cho tăng trưởng kinh tế. Nghiên cứu của Mauro (1995) cho thấy sự tác động tiêu cực của tham nhũng đến đầu tư và qua đó cũng ảnh hưởng đến tăng trưởng. Kết quả này cũng đã nhận được nhiều sự đồng thuận từ các nghiên cứu sau này như Brunetti & Weder (1998) và Mo (2001).

Tuy nhiên, các nhà nghiên cứu khác cho rằng tham nhũng chưa hẳn hoàn toàn tiêu cực mà đôi khi lại có lợi cho tăng trưởng. Bardhan (1997) đã minh họa các trường hợp mà tham nhũng có thể đã thúc đẩy phát triển kinh tế trong một giai đoạn lịch sử của châu Âu và Mỹ. Bên cạnh đó, Beck & Maher (1986) và Lien (1986) lập luận rằng tham nhũng giúp cải thiện hiệu quả hoạt động của chính phủ. Nghiên cứu của Leff (1964), Huntington (2006) và Leys (1965) cũng cho thấy tham nhũng có tác động tích cực đến tăng trưởng kinh tế nhờ việc giảm thiểu các trở ngại từ thủ tục hành chính, sự thiếu minh bạch của hệ thống pháp lý. Từ đó, các tác giả đã ví tham nhũng như chất bôi trơn giúp kích hoạt sự vận hành của một thể chế quan liêu và giảm thiểu các rào cản gây trở ngại cho đầu tư và tăng trưởng.

Các quốc gia đang chuyển đổi có chất lượng thể chế kém và tình trạng tham nhũng luôn ở mức cao. Nguyên nhân của tình trạng này được cho là do điều kiện mức độ dân chủ thấp và tự do kinh tế còn hạn chế. Bên cạnh đó, quyền lực chính trị và sự chi phối của giới công chức đến các hoạt động kinh tế xã hội vẫn còn quá lớn thì việc người dân dùng tiền làm chất bôi trơn là điều khó tránh khỏi. Khi đó, chất bôi trơn này có thể kích hoạt sự vận hành của bộ máy chính quyền và thúc đẩy tăng trưởng kinh tế thông qua cơ chế “speed money” được đề xướng bởi Aidt (2009). Vì vậy, bài viết này hướng đến mục tiêu kiểm định sự tác động của tham nhũng đến tăng trưởng kinh tế tại các quốc gia chuyển đổi có thực sự tích cực, trong đó bài viết quan tâm đến vai trò của chất lượng thể chế trong mối quan hệ này.

## 2. Tổng quan nghiên cứu

Cho đến nay, các nghiên cứu thực nghiệm về mối quan hệ tham nhũng và tăng trưởng đã được khảo sát rất nhiều. Tuy nhiên, phát hiện của các nghiên cứu này vẫn chưa có sự đồng nhất và còn nhiều tranh cãi. Nghiên cứu của Hodge & cộng sự (2011) nhằm khám phá mối quan hệ giữa tham nhũng và tăng trưởng và xác định các yếu tố quyết định của

tham nhũng. Để giải quyết hai mục tiêu trên, các tác giả đã tiến hành xây dựng mô hình và nghiên cứu thực nghiệm với dữ liệu tại 81 quốc gia từ khoảng thời gian 1984-2005 và sử dụng phương pháp bình phương bé nhất ba giai đoạn (3SLS). Kết quả thực nghiệm cho thấy tham nhũng cản trở tăng trưởng bằng cách giảm đầu tư vào vốn vật chất, vốn con người, và gia tăng sự bất ổn chính trị.

Venard (2013) phân tích mối quan hệ giữa chất lượng thể chế, mức độ tham nhũng và sự phát triển kinh tế, bằng cách sử dụng dữ liệu chéo theo các quốc gia ở 120 nước bao gồm cả quốc gia có chất lượng thể chế cao và thấp, dữ liệu được thu thập trong 4 năm 1998, 2001, 2004 và 2007 và phương pháp ước lượng mô hình cấu trúc PLS (Partial least squares). Kết quả thực nghiệm cho thấy cả tham nhũng và chất lượng thể chế có tác động tiêu cực đến phát triển kinh tế. Tuy nhiên, nghiên cứu này cho thấy kết quả thú vị về sự tương tác giữa tham nhũng và chất lượng thể chế đến tăng trưởng. Việc cải thiện chất lượng thể chế và giảm tham nhũng có hiệu quả hơn cho sự phát triển kinh tế ở các nước có chất lượng thể chế thấp so với các nước có chất lượng thể chế cao.

Saha & Gounder (2013) đã thu thập số liệu của 100 quốc gia phát triển và đang phát triển để khảo sát sự tác động của tham nhũng lên tăng trưởng kinh tế bằng các phương pháp hồi quy phức tạp. Nghiên cứu kết luận tham nhũng tác động tiêu cực đến tăng trưởng. Tác giả cũng đề nghị việc thiết lập một nền kinh tế tự do, chính sách thể chế phù hợp sẽ giúp làm giảm tham nhũng.

Tarek & Ahmed (2013) khảo sát sự tác động của tham nhũng đến tăng trưởng của 30 quốc gia đang phát triển từ năm 1998-2011. Kết quả thực nghiệm cho thấy tham nhũng tác động bất lợi đến hoạt động kinh tế và mức độ tham nhũng sẽ nghiêm trọng hơn ở các nước có mức thu nhập thấp, kinh tế ít hòa nhập vào nền kinh tế toàn cầu. Tuy nhiên, tham nhũng trở nên nghiêm trọng hơn ở các nước đang phát triển bởi một hệ thống luật pháp yếu kém và mức thu nhập thấp của giới công chức.

Ngược lại, Heckelman & Powell (2010) nghiên cứu mối quan hệ giữa tham nhũng và tăng trưởng gắn với môi trường thể chế (dân chủ và tự do kinh tế). Nghiên cứu sử dụng dữ liệu của 83 quốc gia trong khoảng thời gian từ năm 1995 – 2005 bằng phương pháp bình phương bé nhất theo trọng số (Weighted Least Squares). Nghiên cứu tìm thấy

những kết quả rất đặc biệt và mối quan hệ này phụ thuộc chủ yếu vào chất lượng thể chế của quốc gia. Cụ thể, tham nhũng được phát hiện là có lợi cho tăng trưởng tại các quốc gia có nền dân chủ cao. Kết quả này dường như là khá đặc biệt nhưng nó phù hợp với nghiên cứu của Méon & Sekkat (2005) và Méndez & Sepúlveda (2006). Ngoài ra, nghiên cứu cũng tìm thấy bằng chứng tham nhũng thúc đẩy tăng trưởng tại các quốc gia có mức độ tự do kinh tế thấp và tác động tích cực này sẽ bị giảm khi tự do kinh tế được cải thiện.

Một số tác giả khác cũng ca ngợi vai trò của tham nhũng trong việc giúp các đại diện kinh tế có thể tránh được những hệ lụy từ các chính sách kém hiệu quả. Lui (1985) đã ứng dụng mô hình xếp hàng trong việc xin cấp giấy chứng nhận kinh doanh và kết quả cho thấy tham nhũng có thể làm giảm thời gian cho việc phải xếp hàng chờ đợi. Lý do là hội lộ cho các quan chức có thể tạo ra động lực để đẩy nhanh tốc độ tiến trình xử lý khi mà hệ thống quản lý hành chính quá chậm chạp. Nghiên cứu lý thuyết tiên phong của Leff (1964) khám phá mối quan hệ thú vị giữa tham nhũng và tăng trưởng. Tham nhũng hoạt động giống như động cơ của tăng trưởng trong điều kiện nền hành chính bị trì hoãn và các quy định hà khắc của chính phủ. Nhờ đó, tham nhũng thúc đẩy hiệu quả của nền kinh tế và tác động tích cực đến tăng trưởng. Bayley (1966) cho rằng tham nhũng có thể khắc phục một bộ máy quan liêu bằng cách cải thiện chất lượng thể chế và có thể giúp doanh nghiệp tư nhân tránh được một chính sách công gây trở ngại cho hoạt động kinh doanh của họ, và qua đó giúp họ tìm ra các giải pháp tích cực và phù hợp. Điều này có thể cho phép cải thiện hiệu quả của chính sách công, thậm chí ông cho rằng nó cũng nằm trong các mục tiêu của chính phủ.

Như vậy, các nghiên cứu trước đây đã đề cập đến vai trò của chất lượng khung thể chế đối với tăng trưởng kinh tế. Knack & Keefer (1995) cho rằng một chính sách công dù tốt đến mức nào cũng trở nên thất bại nếu điều kiện thể chế của quốc gia quá yếu kém. Tuy nhiên, một hạn chế quan trọng của các nghiên cứu này là chỉ tiếp cận khung thể chế chính trị và được đại diện bởi chỉ số dân chủ của các quốc gia. Heckelman & Powell (2010) và Saha & Gounder (2013) cho rằng cách tiếp cận này là chưa phản ánh đầy đủ chất lượng thể chế của quốc gia. Chất lượng thể chế phải bao gồm thể chế chính trị (nền dân chủ) và thể chế kinh tế (tự do kinh tế). Vì

vậy, bài viết này xem xét chất lượng thể chế với hai cách tiếp cận gồm thể chế chính trị và thể chế kinh tế. Bên cạnh đó, để đánh giá vai trò của khung thể chế trong mối quan hệ giữa tham nhũng và tăng trưởng, bài viết sẽ sử dụng biến tương tác giữa tham nhũng và thể chế.

### 3. Dữ liệu và phương pháp ước lượng

#### 3.1. Mô hình thực nghiệm và dữ liệu

Để đánh giá sự tác động của tham nhũng đến tăng trưởng dưới vai trò của khung thể chế, phương trình tuyến tính được xây dựng dựa trên nghiên cứu Heckelman & Powell (2010), Siddiqui & Ahmed (2013) và Lee & Kim (2009) có dạng:

$$\ln\_gdppc_{it} = \beta_0 + \beta_1 cor_{it} + \beta_2 ecofree_{it} + \beta_3 demo_{it} + \beta_4 cor_{it} * ecofree_{it} + \beta_5 cor_{it} * demo_{it} + \beta_6 school_{it} + \beta_7 invest_{it} + \beta_8 pop_{it} + \beta_9 top_{it} + \varepsilon_{it} \quad (1)$$

Trong đó  $i$  và  $t$  là chỉ số về quốc gia và thời gian. Biến phụ thuộc tăng trưởng kinh tế được đại diện bằng biến  $gdppc$ , thu nhập bình quân đầu người theo giá hiện hành và được thu thập từ WDI. Khi đưa vào mô hình biến này được lấy logarit. Biến  $cor$  là chỉ số về tham nhũng được đo lường bằng chỉ số cảm nhận tham nhũng (CPI) và được thu thập từ nguồn của Tổ chức Minh bạch Quốc tế (Transparency International). Chỉ số này được đo lường theo điểm từ 0 đến 10, theo đó quốc gia nào có điểm càng nhỏ thì càng ít tham nhũng và ngược lại. Vì vậy, khi đưa vào mô hình thực nghiệm, tác giả điều chỉnh lại sao cho giá trị càng lớn càng ít tham nhũng bằng cách lấy 10 trừ đi điểm của CPI. Nền kinh tế quốc gia sẽ gặp nhiều khó khăn trong điều kiện tham nhũng tràn lan và khó kiểm soát. Do đó, dấu của  $\beta_1$  được kỳ vọng mang dấu âm (Heckelman et al., 2010; Méon & Sekkat, 2005; Tanzi & Davoodi, 1998). Biến tự do kinh doanh ( $ecofree$ ) được dựa vào báo cáo hàng năm về tự do kinh doanh của Gwartney & cộng sự (2006) (Economic Freedom of the World Annual Report). Các quốc gia muốn gia tăng năng lực cạnh tranh của mình để thu hút đầu tư trong và ngoài nước thì chỉ số tự do kinh tế sẽ được cải thiện. Vì vậy, các quốc gia có chỉ số tự do kinh tế càng cao được kỳ vọng càng thúc đẩy tăng trưởng và cải thiện tác động của tham nhũng đến tăng trưởng, nghĩa là  $\beta_2$  được kỳ vọng mang dấu dương (Heckelman & Powell, 2010). Biến  $demo$  là nền dân chủ được xây dựng bằng cách lấy trung bình của chỉ số quyền chính trị và tự do dân chủ được cung cấp bởi tổ chức Freedom House. Biến này cũng được mã hóa lại sao cho giá trị càng lớn là càng dân chủ (lấy 10 trừ đi giá

trị trung bình của quyền chính trị và tự do dân chủ). Một quốc gia dân chủ sẽ thúc đẩy cơ chế giám sát cũng như sự tự do ngôn luận của báo giới và điều này sẽ đẩy lùi nạn tham nhũng một cách hiệu quả và từ đó sẽ thúc đẩy tăng trưởng. Vì vậy, hệ số  $b_3$  cũng được kỳ vọng mang dấu dương (Heckelman & Powell, 2010).

Nghiên cứu sử dụng biến tỷ lệ học sinh đầu vào cấp tiểu học thể hiện trình độ dân trí của quốc gia để đại diện cho vốn con người (Mankiw & cộng sự, 1990). Trình độ dân trí cải thiện được xem như chất lượng nguồn nhân lực tốt giúp thúc đẩy tăng trưởng kinh tế. Vì vậy hệ số  $b_6$  được kỳ vọng mang dấu dương. Tương tự, biến invest là tỷ lệ vốn đầu tư trên gdp của quốc gia cũng được kỳ vọng mang dấu dương. Biến pop\_growth là tốc độ gia tăng dân số hàng năm đại diện cho hiệu ứng của sự gia tăng nhân khẩu học lên tốc độ tăng thu nhập bình quân đầu người,  $b_8$  được kỳ vọng mang dấu âm. Cuối cùng, biến top thể hiện độ mở nền kinh tế (tổng giá trị xuất khẩu và nhập khẩu) theo gdp. Theo lý thuyết tác động của độ mở lên tăng trưởng là tích cực mặc dù các nghiên cứu thực nghiệm không khẳng định mạnh mẽ hiệu ứng này. Các biến kiểm soát này được thu thập từ WDI.

#### *Kỳ vọng dấu của biến tương tác*

Mục tiêu quan trọng của nghiên cứu này là xem xét vai trò của chất lượng thể chế đối với sự tác động của tham nhũng lên tăng trưởng. Vì vậy, mô hình đưa vào biến tương tác giữa tham nhũng và khung thể chế được thể hiện bằng  $cor*demo$  và  $cor*eco\_free$ . Khi đó, tác động của tham nhũng đến tăng trưởng được thể hiện lần lượt hệ số  $(b_1 + b_5demo)$  và  $(b_1 + b_4ecofree)$  như sau:

- Khi chưa đưa biến tương tác vào mô hình, tác động của tham nhũng lên tăng trưởng được kỳ vọng mang dấu âm, nghĩa là  $b_1 < 0$ .

- Khi đưa biến tương tác  $cor*demo$  vào mô hình, nghiên cứu đánh giá tác động của tham nhũng lên tăng trưởng dưới vai trò của thể chế chính trị. Hệ số tác động trong điều kiện này là  $b_1$  và  $b_5$ . Giả thuyết chất bôi trơn ngụ ý rằng tham nhũng tác động tích cực đến tăng trưởng nếu chất lượng thể chế chính trị là rất thấp. Khi giá trị của biến demo tiến đến 0, nếu  $b_1$  mang dấu dương thì tác động của tham nhũng là tích cực lên tăng trưởng. Và khi chất lượng thể chế được cải thiện, tác động của tham nhũng trở nên tiêu cực đối với tăng trưởng. Khi đó  $b_5$  sẽ mang dấu âm. Vì vậy, giả thuyết chất bôi trơn sẽ không bị bác bỏ

nếu  $b_1 > 0$  và  $b_5 < 0$ . Ngược lại, giả thuyết gây cản trở xảy ra khi  $b_1 < 0$  và  $b_5 > 0$  <sup>1</sup>.

- Tương tự, khi thêm biến tương tác  $cor*ecofree$  vào mô hình, nghiên cứu đánh giá tác động của tham nhũng lên tăng trưởng dưới vai trò của thể chế kinh tế. Hệ số tác động trong điều kiện này là  $b_1$  và  $b_4$ . Giả thuyết chất bôi trơn của tham nhũng trong điều kiện thể chế kinh tế không bị bác bỏ nếu  $b_1 > 0$  và  $b_4 < 0$ .

### **3.2. Phương pháp ước lượng**

Moulton (1986) và Moulton (1990) cho rằng khi sử dụng dữ liệu bảng để phân tích giữa các quốc gia có thể gặp phải sự hiện diện của hiệu ứng nhóm dẫn tới vấn đề sai số trong các kết luận thống kê. Vì vậy, tác giả sử dụng phương pháp ước lượng bình phương tối thiểu tổng quát (GLS) để xử lý hiện tượng tự tương quan của các quan sát trong phạm vi quốc gia và phương sai thay đổi giữa các quốc gia.

Các mô hình tăng trưởng thường bao gồm các biến bị nội sinh. Chẳng hạn, khi đầu tư tăng cao sẽ dẫn đến tăng trưởng cao, sau đó khi tăng trưởng cao sẽ thúc đẩy đầu tư nhiều hơn. Saha & Gounder (2013) nghi ngờ sự ngoại sinh của biến tham nhũng khi việc đo lường biến này tương quan chặt chẽ và tăng mạnh cùng với mức độ phát triển kinh tế. Điều này dẫn đến vấn đề đồng thời làm cho các ước lượng truyền thống bị chệch.

Ước lượng GMM là kỹ thuật ước lượng dựa vào biến công cụ và có nhiều ưu điểm so với các ước lượng truyền thống (2SLS). Ước lượng truyền thống sẽ không chính xác khi có sự hiện diện của phương sai thay đổi. Ước lượng GMM sử dụng các điều kiện moment cho phép tạo ra các ước lượng chính xác ngay cả khi có sự xuất hiện của sự không nhất quán của các đơn vị chéo (Hansen, 2000).

Để kiểm tra tính vững của ước lượng, nghiên cứu sử dụng phương pháp GMM sai phân được phát triển cho mô hình bảng động tuyến tính (Arellano & Bond, 1991; Arellano & Bover, 1995; Holtz-Eakin & cộng sự, 1988). Trong mô hình bảng động, sự hiện diện của biến trễ của biến phụ thuộc có thể dẫn đến hiện tượng tự tương quan. Khi đó, ước lượng GMM sai phân sẽ xử lý được vấn đề này bằng cách lấy giá trị trễ của các biến phụ thuộc làm công cụ. Ngoài ra, khi chuyển sang hồi quy với biến sai phân bậc 1, các thiên chệch tiềm ẩn do bỏ sót biến và các hiệu ứng cố định của các đơn vị chéo (địa lý, nhân khẩu học) cũng sẽ được loại bỏ. Cuối cùng, Johnson



**Bảng 1: Thống kê mô tả biến**

Biến	Quan sát	Trung bình	Độ lệch chuẩn	Lớn nhất	Nhỏ nhất
ln_gdppc	506	2,92	0,34	3,59	2,03
cor	506	7,27	0,58	8,4	4,7
demo	506	5,92	1,32	8,5	3,5
ecofree	506	6,34	0,66	7,73	4,53
top	506	81,79	35,17	209,87	21,67
pop	506	2,01	1,00	3,85	-0,99
invest	506	23,10	7,98	3,94	63,94
school	506	103,37	17,90	149,95	41,04

& cộng sự (1998) và Roodman (2006) cho rằng GMM sai phân thích hợp cho dữ liệu bảng với thời gian ngắn và số đơn vị chéo lớn.

Sau đó, tác giả kiểm định khả năng xảy ra tự tương quan của sai số mô hình và giá trị của biến công cụ. Kiểm định Arellano-Bond về tự tương quan có giả thuyết H0: không tự tương quan và được áp dụng cho số dư sai phân. Kiểm định tiến trình AR(1) trong sai phân bậc 1 thường bác bỏ giả thuyết H0. Cho nên, kiểm định AR(2) quan trọng hơn bởi vì nó kiểm tra tự tương quan ở các cấp độ. Tính hợp lý của các biến công cụ được sử dụng trong ước lượng GMM được đánh giá qua thống kê Sargan. Kiểm định Sargan là kiểm định giới hạn về nội sinh của mô hình (overidentifying restrictions). Kiểm định Sargan với giả thuyết H0 biến công cụ là biến ngoại sinh, nghĩa là không tương quan với sai số trong mô hình. Vì vậy, giá trị thống kê Sargan càng lớn càng tốt.

Kết quả cho thấy biến thu nhập bình quân của các quốc gia trong giai đoạn khảo sát tương đối thấp và mức độ chênh lệch thu nhập khá lớn. Một số quốc gia có thu nhập cao lên đến 3.891 USD trong khi các quốc gia có thu nhập thấp thì chỉ 108 USD.

Kết quả thống kê mô tả các biến trong mẫu khảo sát cho thấy giá trị trung bình chỉ số tham nhũng ở các quốc gia có nền kinh tế chuyển đổi là 7.2/10. Chỉ số này cho thấy mức độ tham nhũng ở các quốc gia này là tương đối cao, trong đó có một số quốc

gia mức tham nhũng lên tới 8.4 chẳng hạn Cambodia, Chad, Burundi... Tuy nhiên, trong các quốc gia khảo sát thì cũng có một số quốc gia tỷ lệ tham nhũng thấp hơn mức trung bình của tổ chức Minh bạch Quốc tế gồm có Georgia và Rwanda ở mức 4.7 và 4.8.

Cuối cùng, giá trị trung bình của chỉ số tự do kinh tế là 6.3/10 và tự do dân chủ là 5.9/10. Giá trị này cho thấy chất lượng khung thể chế ở các quốc gia có nền kinh tế chuyển đổi chỉ ở mức trung bình khá. Tuy vậy, vẫn có một số quốc gia có chất lượng thể chế rất thấp khi mà giá trị nhỏ nhất của chỉ số này chỉ ở mức 4.5 và 3.5.

Kết quả thống kê hệ số tương quan Pearson giữa các biến trong mô hình thực nghiệm được thể hiện tại Bảng 2. Kết quả cho thấy dấu của các biến giải thích trong mô hình là phù hợp với kỳ vọng và đều có ý nghĩa thống kê ở mức 1% và 5%. Ngoài ra, hệ số tương quan giữa các cặp biến tương đối nhỏ nên khả năng xuất hiện đa cộng tuyến trong mô hình hồi quy là thấp (Evans, 1996).

#### 4. Kết quả thực nghiệm và thảo luận

##### 4.1. Kết quả thực nghiệm mô hình tuyến tính

Để khắc phục hiện tượng không đồng nhất phương sai giữa các đơn vị chéo và khả năng xảy ra tự tương quan giữa các quan sát của từng quốc gia, nghiên cứu sử dụng phương pháp ước lượng GLS để ước lượng các hệ số hồi quy của mô hình.

Bảng 3 thể hiện kết quả hồi quy sự tác động của

**Bảng 2: Ma trận hệ số tương quan**

Biến	ln_gdppc	cor	demo	ecofree	school	invest	pop
cor	-0,2453***						
demo	0,1420***	-0,3918***					
ecofree	0,3888***	-0,3077***	0,2747***				
school	0,1129**	-0,1131**	0,0505	0,3238***			
invest	0,0816*	-0,1772***	0,1930***	0,1089**	0,0442		
pop	-0,5487***	0,1585***	-0,1299***	-0,3238***	-0,1869***	-0,0851*	
top	0,2941***	0,0537	-0,0922**	0,1161***	0,1173***	0,1983***	-0,3910***

Ghi chú: \*, \*\*, \*\*\* biểu thị cho ý nghĩa thống kê ở mức 10%, 5% và 1%

**Bảng 3: Kết quả hồi quy giữa các biến bằng phương pháp GLS**

Biến	(1) GLS	(2) GLS	(3) GLS
cor	-0,0338***	0,1605*	0,1712***
demo	0,0096	0,0083	0,2066***
ecofree	0,0742***	0,2868***	0,0567***
school	0,0021***	0,0022***	0,0012*
invest	0,0015*	0,0015*	0,0014**
pop	-0,1238***	-0,1153***	-0,1179***
top	0,0003	0,0004	-0,0005**
cor*demo		-0,0300**	
cor*ecofree			-0,0265***
Constant	2,5998***	1,1907*	1,3205***
Wald test (p-value)	0,0000	0,0000	0,0000
Quan sát	506	506	506
Quốc gia	46	46	46

Ghi chú: \*, \*\*, \*\*\* biểu thị cho ý nghĩa thống kê ở mức 10%, 5% và 1%

tham nhũng đến tăng trưởng kinh tế. Trong trường hợp tác giả kiểm soát bằng khung thể chế (biến dân chủ và biến tự do kinh tế) và các yếu tố kinh tế xã hội (cột 1), hệ số của biến cor mang dấu âm và có ý nghĩa thống kê ở mức 1%. Kết quả này ủng hộ quan điểm cho rằng tham nhũng gây cản trở cho tăng trưởng kinh tế mà đã được phát hiện trong các nghiên cứu của Heckelman & Powell (2010), Méon & Sekkat (2005) và Tanzi & Davoodi (1998). Kết quả này phản ánh đúng thực trạng hiện nay tại các quốc gia có thu nhập thấp. Số liệu thực tế đã cho thấy các quốc gia Cambodia, Chad, Burundi có mức thu nhập bình quân thấp trong nhóm các quốc gia khảo sát (khoảng từ 117 USD đến dưới 1.040 USD) nhưng chỉ số tham nhũng của các quốc gia này lại thuộc nhóm cao nhất (từ 7.7 đến 8.4).

Bên cạnh đó, kết quả cột 1 cũng cho thấy mức độ tự do kinh tế và mức độ dân chủ có tác động tích cực đối với tăng trưởng, tuy nhiên, tác động của biến mức độ dân chủ (demo) là không có ý nghĩa thống kê. Phát hiện này cho thấy vai trò quan trọng của chất lượng thể chế đối với tăng trưởng đặc biệt là các quốc gia có nền kinh tế chuyển đổi (Heckelman & Powell, 2010; Lee & Kim., 2009). Kết quả thống kê mô tả cho thấy các quốc gia chuyển đổi có mức độ dân chủ thấp và tự do kinh tế chỉ ở mức trên trung bình. Điều này có thể là một trong những nguyên nhân gây bất lợi cho tăng trưởng ở các quốc gia này. Vì vậy, việc cải thiện chất lượng thể chế thông qua việc tăng cường mức độ tự do kinh tế và mở rộng mức độ dân chủ chắc chắn sẽ mang lại nhiều mặt tích cực cho việc thúc đẩy tăng trưởng kinh tế.

Ngoài ra, kết quả thực nghiệm cho thấy tỷ lệ đầu tư có tác động tích cực đến tăng trưởng của quốc

gia. Kết quả này lần nữa khẳng định vai trò quan trọng của yếu tố vốn vật chất trong các mô hình tăng trưởng đã được đề cập trong nhiều nghiên cứu trước đây. Điều này cho thấy tăng trưởng kinh tế tại các quốc gia chuyển đổi vẫn phụ thuộc vào tăng trưởng vốn. Kết quả này phản ánh đúng thực trạng hiện nay về trình độ phát triển và khả năng ứng dụng khoa học công nghệ vào sản xuất còn hạn chế tại các nền kinh tế này. Kết quả này giống với kết quả thực nghiệm trong tất cả bốn giai đoạn khảo sát của Ekanayake & Chatrna (2010).

Cuối cùng, hệ số hồi quy của biến pop mang dấu âm và có ý nghĩa thống kê. Kết quả này hàm ý tăng trưởng kinh tế tại các quốc gia chuyển đổi không phụ thuộc vào tốc độ tăng trưởng vốn lao động. Ngược lại, tốc độ gia tăng dân số gây trở ngại cho tiến trình phát triển kinh tế ở các quốc gia này. Điều này có thể được lý giải là do tỷ lệ thất nghiệp tại các quốc gia này hiện ở mức khá cao (trung bình chiếm 7,6% dân số), do đó việc bổ sung thêm nguồn lực lao động không có ý nghĩa cho tăng trưởng mà đôi khi trở thành áp lực về mặt kinh tế xã hội.

#### 4.2. Kết quả thực nghiệm mô hình biến tương tác

Tuy nhiên, mục tiêu chủ yếu của nghiên cứu này là kiểm chứng sự tồn tại của giả thuyết chất bôi trơn của tham nhũng. Vì vậy, tác giả đã lần lượt thêm vào mô hình biến tương tác giữa tham nhũng và các biến đại diện cho chất lượng thể chế.

Cột 2 thể hiện kết quả hồi quy khi thêm vào mô hình biến tương tác giữa tham nhũng và dân chủ (thể chế chính trị). Khi đó, hệ số hồi quy của biến cor mang dấu dương và hệ số hồi quy của biến tương tác cor\*demo mang dấu âm và có ý nghĩa thống kê. Điều cho thấy giống với kỳ vọng dấu của

giả thuyết về chất bôi trơn của tham nhũng. Tác động biên của tham nhũng lên tăng trưởng là  $0,1605 - 0,03 \cdot \text{demo}$ . Vì vậy, khi biến demo nhận giá trị thấp từ 0 đến 5 (dưới mức trung bình) thì tác động biên của tham nhũng vẫn mang dấu dương, nghĩa là tham nhũng tác động tích cực đến tăng trưởng khi chất lượng thể chế chính trị là thấp. Ngược lại, khi giá trị của biến demo tăng lên ở mức trên 6 thì tác động biên này trở nên mang dấu âm, nghĩa là tham nhũng trở nên tiêu cực cho tăng trưởng khi chất lượng thể chế chính trị được cải thiện. Kết quả này khẳng định sự tồn tại của giả thuyết chất bôi trơn của tham nhũng lên tăng trưởng khi chất lượng thể chế chính trị là thấp.

Trương tự, khi thêm vào mô hình biến tương tác  $\text{cor} \cdot \text{ecofree}$  (cột 3) kết quả hồi quy cũng cho thấy hệ số hồi quy của biến cor mang dấu dương và của biến tương tác mang dấu âm (phù hợp với giả thuyết kỳ vọng dấu). Tác động biên của tham nhũng lên tăng trưởng là  $0,1712 - 0,0265 \cdot \text{ecofree}$ . Nếu biến ecofree nhận giá trị từ 0 đến 8 thì tác động này vẫn mang dấu dương và chỉ chuyển sang dấu âm khi ecofree đạt giá trị trên 8. Điều này có nghĩa là trong điều kiện mức độ tự do kinh tế thấp, tham nhũng sẽ trở thành chất bôi trơn giúp thúc đẩy tăng trưởng, nhưng khi mức độ tự do kinh tế được cải thiện thì tham nhũng trở nên tiêu cực cho tăng trưởng. Kết quả này cũng phù hợp với nghiên cứu của Venard (2013).

Tóm lại, kết quả thực nghiệm khẳng định có tồn tại lý thuyết chất bôi trơn của tham nhũng tại các quốc gia chuyển đổi. Nghĩa là, trong điều kiện chất

lượng thể chế tương đối thấp, tham nhũng có thể giúp kích hoạt cơ chế vận hành của nền hành chính còn nặng tính quan liêu, trì trệ, giúp khắc phục các rào cản của chính sách thiếu minh bạch và từ đó giúp thúc đẩy tăng trưởng kinh tế.

#### 4.3. Phân tích tính vững bằng phương pháp D-GMM

Như đã phân tích, tham nhũng và tăng trưởng có mối quan hệ tương hỗ lẫn nhau. Bên cạnh đó, chất lượng thể chế và các yếu tố kinh tế xã hội cũng tác động đến cả tham nhũng và tăng trưởng. Vì vậy, để xử lý vấn đề nội sinh và khả năng bị phương sai thay đổi của sai số trong mô hình, nghiên cứu sử dụng phương pháp ước lượng GMM sai phân để kiểm định tính vững của ước lượng trên. Kết quả được thể hiện trong Bảng 4.

Cột 4 cho thấy dấu của các biến demo, ecofree, investment, pop, top và school đều không thay đổi. Điều này cho thấy kết quả thực nghiệm sự tác động của các biến này đến tăng trưởng là vững. Riêng chỉ có biến cor là bị thay đổi dấu nên tác động của biến này là không vững.

Cột 5 thể hiện kết quả hồi quy D-GMM khi thêm biến tương tác  $\text{cor} \cdot \text{demo}$ , kết quả cho thấy dấu của các hệ số hồi quy của các biến cor, demo, ecofree và  $\text{cor} \cdot \text{demo}$  là tương tự kết quả trên cột 2 của bảng 3. Vì vậy, sự tác động của các biến này là vững.

Và cuối cùng, cột 6 cũng thể hiện kết quả hồi quy khi thêm biến tương tác  $\text{cor} \cdot \text{ecofree}$ . Tuy nhiên, kết quả cho thấy hệ số hồi quy của biến tương tác này không có ý nghĩa thống kê mặc dù dấu là không đổi so với ước lượng GLS.

**Bảng 4: Kết quả hồi quy các biến bằng phương pháp D-GMM**

Biến	(4) D-GMM	(5) D-GMM	(6) D-GMM
$\ln\_gdppc(-1)$	0,9574***	0,8576***	0,8153***
cor	0,0993**	1,7704**	0,5069*
demo	0,1379*	0,1326**	0,5544*
ecofree	0,0346	1,933*	0,0099
school	0,0034	0,0028	0,0092*
pop	-0,1761**	-0,1558*	-0,06
top	0,0033*	0,0027*	0,0058***
invest	0,0097*	0,0065*	0,0013
$\text{cor} \cdot \text{demo}$		-0,2581*	
$\text{cor} \cdot \text{ecofree}$			-0,0644
AR(2)	0,768	0,333	0,833
Sargan test	0,381	0,229	0,288
Quan sát	368	368	368
Quốc gia	46	46	46

Ghi chú: \*, \*\*, \*\*\* biểu thị cho ý nghĩa thống kê ở mức 10%, 5% và 1%.

## 5. Kết luận và hàm ý chính sách

Nghiên cứu sự tác động của tham nhũng đến tăng trưởng dưới vai trò của chất lượng thể chế sử dụng bộ dữ liệu của 46 quốc gia có nền kinh tế chuyển đổi trong giai đoạn 2002-2012. Phương pháp chủ yếu trong nghiên cứu là GLS để xác định độ lớn của các hệ số hồi quy. Và phương pháp GMM được dùng để kiểm tra tính vững cho mô hình. Kết quả thực nghiệm cho ra những kết luận và hàm ý chính sách như sau:

*Thứ nhất*, trong điều kiện chất lượng thể chế kinh tế hiện nay còn quá thấp, tham nhũng trở thành chất bôi trơn thúc đẩy tăng trưởng. Điều này hàm ý rằng các quốc gia chuyển đổi nếu thực hiện chính sách cứng rắn để bài trừ tham nhũng thì phải chấp nhận sự đình trệ của nền kinh tế. Bởi vì, các quốc gia đang chuyển đổi không được đánh giá cao về các chính sách nhằm thúc đẩy sự tự do kinh doanh. Khi mà vẫn còn tồn tại các rào cản và sự bất minh trong chính sách kinh tế, thiếu sự minh bạch thì khu vực tư nhân khó có thể xâm nhập, tham gia hoạt động kinh doanh tại các quốc gia này. Vì vậy, để giúp tăng trưởng kinh tế lâu dài và ổn định, các quốc gia này cần phải cải thiện mức độ tự do kinh doanh dựa vào 37 tiêu chí của Gwartney & cộng sự (2006). Chính việc làm này sẽ tạo ra môi trường kinh doanh thông thoáng và minh bạch, từ đó giúp thu hút đầu tư, cải thiện được tăng trưởng kinh tế và khi đó vấn nạn tham nhũng sẽ được đẩy lùi một cách hiệu quả.

*Thứ hai*, tham nhũng cũng đóng vai trò chất bôi trơn thúc đẩy sự vận hành của thể chế chính trị và qua đó góp phần thúc đẩy tăng trưởng khi điều kiện mức độ dân chủ còn thấp. Nghĩa là tham nhũng thực hiện chức năng làm chất xúc tác đẩy nhanh tiến độ

xử lý công việc hành chính đang còn mang nặng tính quan liêu, trì trệ và giúp khu vực tư tiết kiệm được thời gian khi sử dụng dịch vụ công. Qua đó, tham nhũng được cho là có tác động tích cực đến tăng trưởng. Tuy nhiên, về khía cạnh đạo đức, không thể dựa vào tham nhũng vì mục tiêu tăng trưởng. Khảo sát xã hội học về phòng chống tham nhũng được thực hiện bởi Ngân hàng Thế giới tại các quốc gia đang phát triển năm 2013 cho thấy cán bộ công chức tùy tiện trong quyết định của mình bị nhìn nhận như đang gây khó khăn cho người dân và doanh nghiệp để vôi các khoản tiền không chính thức. Nhiều doanh nghiệp nói rằng họ phải trả những khoản ngoài quy định chỉ để giải quyết nhanh công việc và tránh các thủ tục phiền hà. Vì vậy, việc cải thiện chất lượng thể chế chính trị thông qua việc thực hiện cải cách hành chính, trao quyền cho các cơ quan truyền thông, mở rộng quyền bầu cử tự do và công bằng sẽ giúp loại bỏ sự tùy tiện đang giúp giới công chức có thể lạm dụng để tham nhũng. Khi chất lượng thể chế được cải thiện, doanh nghiệp sẽ tránh được các rào cản về mặt thủ tục hành chính mà không phải chi thêm khoản chi phí nào qua đó sẽ góp phần tạo động lực thu hút doanh nghiệp đầu tư nhằm thúc đẩy tăng trưởng.

*Và cuối cùng*, các yếu tố về kinh tế xã hội như tỷ lệ đầu tư, trình độ dân trí và độ mở thương mại có tác động tích cực đến tăng trưởng kinh tế. Khi trình độ dân trí được cải thiện cũng sẽ dễ dàng trong việc thực hiện các mục tiêu mở rộng nền dân chủ, cải thiện mức độ tự do kinh doanh và hạn chế tình trạng tham nhũng tại các nền kinh tế chuyển đổi. Chính điều này sẽ giúp các quốc gia đạt được mục tiêu tăng trưởng ổn định và bền vững về sau. □

## Ghi chú

1. Xem thêm giả thuyết chất bôi trơn của Méon & Sekkat (2005).

### Tài liệu tham khảo

- Aidt, T. S. (2009), 'Corruption, institutions, and economic development', *Oxford Review of Economic Policy*, 25(2), 271-291.
- Arellano, M., & Bond, S. (1991), 'Some tests of specification for panel data: Monte Carlo evidence and an application to employment equations', *The review of economic studies*, 58(2), 277-297.
- Arellano, M., & Bover, O. (1995), 'Another look at the instrumental variable estimation of error-components models', *Journal of econometrics*, 68(1), 29-51.
- Bardhan, P. (1997), 'Corruption and development: a review of issues', *Journal of economic literature*, 35(03), 1320-1346.
- Bayley, D. H. (1966), 'The effects of corruption in a developing nation', *The Western Political Quarterly*, 19, 719-



- Beck, P. J., & Maher, M. W. (1986), 'A comparison of bribery and bidding in thin markets', *Economics letters*, 20(1), 1-5.
- Brunetti, A., & Weder, B. (1998), 'Investment and institutional uncertainty: a comparative study of different uncertainty measures', *Weltwirtschaftliches Archiv*, 134(3), 513-533.
- Choe, C., Dzhumashev, R., Islam, A., & Khan, Z. H. (2013), 'The Effect of Informal Networks on Corruption in Education: Evidence from the Household Survey Data in Bangladesh', *The Journal of Development Studies*, 49(2), 238-250.
- Ekanayake, E., & Chatrna, D. (2010), 'The effect of foreign aid on economic growth in developing countries', *Journal of International Business and Cultural Studies*, 3(2), 1-13.
- Evans, P. (1996), 'Government action, social capital and development: reviewing the evidence on synergy', *World development*, 24(6), 1119-1132.
- Gwartney, J., Lawson, R., & Hall, J. (2006), *Economic freedom of the world*, Annual report, Fraser Institute.
- Hansen, B. E. (2000), 'Testing for structural change in conditional models', *Journal of Econometrics*, 97(1), 93-115.
- Heckelman, J. C., & Powell, B. (2010), 'Corruption and the institutional environment for growth', *Comparative Economic Studies*, 52(3), 351-378.
- Hodge, A., Shankar, S., Rao, D., & Duhs, A. (2011), 'Exploring the links between corruption and growth', *Review of Development Economics*, 15(3), 474-490.
- Holtz-Eakin, D., Newey, W., & Rosen, H. S. (1988), 'Estimating vector autoregressions with panel data', *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 56(6), 1371-1395.
- Huntington, S. P. (2006), *Political order in changing societies*, Yale University Press.
- Johnson, S., Kaufmann, D., & Zoido-Lobaton, P. (1998), 'Regulatory discretion and the unofficial economy', *The American Economic Review*, 88(2), 387-392.
- Knack, S., & Keefer, P. (1995), 'Institutions and economic performance: Cross-country tests using alternative institutional measures', *Economics & Politics*, 7(3), 207-227.
- Lee, K., & Kim, B.-Y. (2009), 'Both institutions and policies matter but differently for different income groups of countries: Determinants of long-run economic growth revisited', *World Development*, 37(3), 533-549.
- Leff, N. H. (1964), 'Economic development through bureaucratic corruption', *American behavioral scientist*, 8(3), 8-14.
- Leys, C. (1965), 'What is the Problem about Corruption?', *The Journal of Modern African Studies*, 3(02), 215-230.
- Lien, D.-H. D. (1986), 'A note on competitive bribery games', *Economics Letters*, 22(4), 337-341.
- Lui, F. T. (1985), 'An equilibrium queuing model of bribery', *The journal of political economy*, 39(4), 760-781.
- Mankiw, N. G., Romer, D., & Weil, D. N. (1990), 'A contribution to the empirics of economic growth', *The Quarterly Journal of Economics*, May, 407-437.
- Mauro, P. (1995), 'Corruption and growth', *The quarterly journal of economics*, 110(3), 681-712.
- Méndez, F., & Sepúlveda, F. (2006), 'Corruption, growth and political regimes: cross country evidence', *European Journal of Political Economy*, 22(1), 82-98.
- Méon, P.-G., & Sekkat, K. (2005), 'Does corruption grease or sand the wheels of growth?', *Public choice*, 122(1-2), 69-97.
- Mo, P. H. (2001), 'Corruption and economic growth', *Journal of comparative economics*, 29(1), 66-79.
- Moulton, B. R. (1986), 'Random group effects and the precision of regression estimates', *Journal of econometrics*, 32(3), 385-397.
- Moulton, B. R. (1990), 'An illustration of a pitfall in estimating the effects of aggregate variables on micro units', *The review of Economics and Statistics*, 72, 334-338.

- Niskanen, W. A. (1974), *Bureaucracy and representative government*, Transaction Publishers.
- Roodman, D. (2006), 'How to do xtabond2: An introduction to difference and system GMM in Stata', *Stata Journal*, 9(1), 86-136.
- Saha, S., & Gounder, R. (2013), 'Corruption and economic development nexus: variations across income levels in a non-linear framework', *Economic Modelling*, 31, 70-79.
- Siddiqui, D. A., & Ahmed, Q. M. (2013), 'The effect of institutions on economic growth: A global analysis based on GMM dynamic panel estimation', *Structural Change and Economic Dynamics*, 24, 18-33.
- Tanzi, V., & Davoodi, H. (1998), 'Corruption, public investment, and growth', IMF Working Paper, WP/97/139.
- Tarek, B. A., & Ahmed, Z. (2013), 'Governance and Economic Performance in Developing Countries: An Empirical Study', *Journal of Economics Studies and Research*, 2013, b1-13.
- Tullock, G. (1965), *The politics of bureaucracy*, Public Affairs Pr.
- Tullock, G. (1967), 'The welfare costs of tariffs, monopolies, and theft', *Economic Inquiry*, 5(3), 224-232.
- Venard, B. (2013), 'Institutions, Corruption and Sustainable Development', *Economics Bulletin*, 33(4), 2545-2562.

---

**Thông tin tác giả:**

**\*Đặng Văn Cường**, Thạc sỹ

- Tổ chức tác giả công tác: Khoa Tài chính Công, Trường Đại học Kinh tế Thành phố Hồ Chí Minh

- Lĩnh vực nghiên cứu chính: Tài chính công; Chính sách công

- Một số Tạp chí tác giả đã đăng tải công trình nghiên cứu: *Tạp chí Phân tích và Dự báo*, *Tạp chí Công nghệ Ngân hàng*, *Tạp chí Phát triển Hội nhập*, *Tạp chí Kinh tế và Phát triển*.

- Địa chỉ Email: dangcuong@ueh.edu.vn