

**BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO
TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ TP.HCM**



ĐẶNG VĂN CƯỜNG

**THAM NHỮNG VÀ TĂNG TRƯỞNG KINH TẾ
TẠI CÁC QUỐC GIA CHUYỂN ĐỔI**

LUẬN ÁN TIẾN SĨ KINH TẾ

TP.HCM, NĂM 2016

**BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO
TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ TP.HCM**



ĐẶNG VĂN CƯỜNG

**THAM NHỮNG VÀ TĂNG TRƯỞNG KINH TẾ
TẠI CÁC QUỐC GIA CHUYỂN ĐỔI**

Chuyên ngành: Tài chính – Ngân hàng

Mã số: 60340201

LUẬN ÁN TIẾN SĨ KINH TẾ

Người hướng dẫn khoa học:

1. PGS. TS Vũ Thị Minh Hằng
2. TS Nguyễn Thị Huyền

TP.HCM, NĂM 2016

LỜI CAM ĐOAN



Tôi xin cam đoan luận án Tiến sĩ với đề tài “**Tham nhũng và tăng trưởng kinh tế tại các quốc gia chuyển đổi**” là công trình nghiên cứu độc lập của tôi. Các thông tin, số liệu trong luận án là trung thực, có nguồn gốc trích dẫn rõ ràng, cụ thể và chưa từng được công bố trong bất kỳ công trình nghiên cứu nào khác.

TP.HCM, ngày 5 tháng 10 năm 2016

Nghiên cứu sinh

Đặng Văn Cường

DANH MỤC CÁC CHỮ VIẾT TẮT



2SLS: Two Stage Least Square (bình phương tối thiểu hai giai đoạn)

AIC: Akaike's information Criterion

SIC: Schwaz Information Criterion

DGMM: difference GMM (GMM sai phân)

FDI: Foreign Direct Investment (đầu tư trực tiếp nước ngoài)

FEM: Fixed Effect Model (mô hình hiệu ứng cố định)

GMM: Generalized Method of Moments (phương pháp ước lượng tổng quát hóa dựa trên moment)

GSL: Generalized Least Square (bình phương tối thiểu tổng quát hóa)

PRS: Political Risk Service

REM: Random Effect Model (mô hình hiệu ứng ngẫu nhiên)

TFP: Total Factor Productivity (nhân tố sản xuất tổng hợp)

DANH MỤC BẢNG BIỂU



Trang

Chương 2 Khung lý thuyết các yếu tố tác động tham nhũng

Bảng 2.1: Các yếu tố tác động đến tham nhũng 41

Chương 3 Khung lý thuyết tham nhũng tác động đến tăng trưởng

Bảng 3.1: Tổng hợp các nghiên cứu thực nghiệm 69

Chương 4 Kết quả nghiên cứu và thảo luận

Bảng 4.1: Các biến sử dụng trong mô hình..... 93

Bảng 4.2: Thống kê mô tả biến 94

Bảng 4.3 : Ma trận hệ số tương quan các biến..... 105

Bảng 4.4 : Ma trận hệ số tương quan các biến..... 106

Chương 5 Kết quả nghiên cứu và thảo luận

Bảng 5.1 : Kiểm định tính dừng các biến 110

Bảng 5.2 : Kết quả lựa chọn độ trễ tối ưu 111

Bảng 5.3 : Kiểm định quan hệ nhân quả Granger..... 112

Bảng 5.4 : Kết quả kiểm định Wald..... 112

Bảng 5.5 : Kết quả hồi quy các biến 114

Bảng 5.6 : Kết quả hồi quy bằng PP ước lượng 2SLS..... 125

Bảng 5.7 : Hiệu ứng từng phân 128

Bảng 5.8 : Mối quan hệ giữa thu nhập và tham nhũng 132

Bảng 5.9 : Kết quả hồi quy bằng PP 2SLS 135

Bảng 5.10 : Kết quả kiểm định hiệu ứng hội tụ 138

Bảng 5.11 : Kết quả hồi quy bằng PP GLS..... 139

Bảng 5.12 : Kết quả hồi quy PP GMM..... 152

DANH MỤC HÌNH VÀ BIỂU ĐỒ



Trang

Chương 1 Giới thiệu tổng quan về nghiên cứu

Hình 1.1 Tham nhũng và tăng trưởng kinh tế..... 9

Hình 1.2 Quy trình thực hiện nghiên cứu 17

Chương 2 Khung lý thuyết các yếu tố tác động tham nhũng

Hình 2.1: Lý thuyết nguyên nhân gây ra tham nhũng..... 34

Chương 3 Khung lý thuyết tham nhũng tác động đến tăng trưởng

Hình 3.1: Các kênh truyền dẫn của tham nhũng đến tăng trưởng 59

Chương 4 Kết quả nghiên cứu và thảo luận

Biểu đồ 4.1: Tham nhũng tại các quốc gia chuyển đổi..... 95

Biểu đồ 4.2 : Thu nhập bình quân..... 96

Biểu đồ 4.3 : Mức độ tự do kinh tế 97

Biểu đồ 4.4 : Mức độ tự do dân chủ..... 98

Biểu đồ 4.5 : Tỷ lệ thất nghiệp..... 99

Biểu đồ 4.6 : Tỷ lệ lạm phát..... 100

Biểu đồ 4.7 : Tốc độ tăng dân số..... 101

Biểu đồ 4.8 : Độ mở thương mại..... 102

Biểu đồ 4.9 : Tỷ lệ học sinh 103

Biểu đồ 4.10 : Tỷ lệ đầu tư..... 104

Biểu đồ 4.11 : Tỷ lệ chi tiêu dùng công 105

Chương 5 Kết quả nghiên cứu và thảo luận

Biểu đồ 5.1 : Mối quan hệ giữa tự do kinh tế và tham nhũng 115

Biểu đồ 5.2 : Mối quan hệ giữa dân chủ và tham nhũng 117

Biểu đồ 5.3 : Mối quan hệ giữa thu nhập và tham nhũng..... 119

Biểu đồ 5.4 : Mối quan hệ giữa lạm phát và tham nhũng..... 120

Biểu đồ 5.5: Mối quan hệ giữa trình độ dân trí và tham nhũng.....	121
Biểu đồ 5.6: Mối quan hệ giữa tỷ lệ thất nghiệp và tham nhũng.....	122
Biểu đồ 5.7: Mối quan hệ giữa nguồn gốc pháp lý và tham nhũng.....	123
Biểu đồ 5.8 : Tác động từng phần của tự do kinh tế.....	129
Biểu đồ 5.9 : Tác động từng phần của dân chủ.....	130
Biểu đồ 5.10 : Mối quan hệ phi tuyến giữa thu nhập và tham nhũng.....	134
Biểu đồ 5.11 : Tác động tham nhũng đến tăng trưởng	141
Biểu đồ 5.12 : Tác động tự do kinh tế đến tăng trưởng	141
Biểu đồ 5.13 : Tác động dân chủ đến tăng trưởng.....	143
Biểu đồ 5.14 : Tác động đầu tư đến tăng trưởng	144
Biểu đồ 5.15 : Tác động trình độ dân trí.....	145
Biểu đồ 5.16 : Tác động tốc độ tăng dân số.....	146
Biểu đồ 5.17 : Tác động chi tiêu dùng công	147
Biểu đồ 5.18 : Hiệu ứng tương tác của dân chủ và tham nhũng.....	149
Biểu đồ 5.19 : Hiệu ứng tương tác của tự do kinh tế và tham nhũng.....	150

MỤC LỤC



Trang

Chương 1 Giới thiệu khái quát về đề tài nghiên cứu.....	1
1.1. Tính cấp thiết của luận án.....	1
1.2. Tình hình nghiên cứu có liên quan	4
1.3. Khoảng trống nghiên cứu và mục tiêu.....	9
1.4. Đối tượng và phạm vi nghiên cứu	12
1.5. Phương pháp nghiên cứu	12
1.6. Kết quả và đóng góp mới của luận án	15
1.7. Quy trình nghiên cứu.....	16
1.8. Kết cấu của luận án.....	17
Chương 2 Khung lý thuyết các yếu tố tác động tham nhũng	20
<i>Giới thiệu chương 2</i>	<i>20</i>
2.1. Khung khái niệm.....	21
2.1.1. Tổng quan về thể chế.....	21
2.1.2. Tổng quan về tham nhũng	25
2.2. Lý thuyết các yếu tố tác động đến tham nhũng	30
2.3. Các nghiên cứu thực nghiệm	34
Kết luận chương 2	42
Chương 3 Lý thuyết tác động tham nhũng đến tăng trưởng.....	43
<i>Giới thiệu chương 3</i>	<i>43</i>
3.1. Khái niệm tổng quan	44

3.2. Lý thuyết tăng trưởng kinh tế.....	46
3.2.1. Tham nhũng và tăng trưởng.....	46
3.2.2. Kênh truyền dẫn tác động của tham nhũng	52
3.3. Các nghiên cứu thực nghiệm	60
3.2.1. Bằng chứng thực nghiệm về tác động tiêu cực.....	60
3.2.2. Bằng chứng thực nghiệm về tác động tích cực.....	65
Kết luận chương 3	71
Chương 4 Mô hình, phương pháp và dữ liệu nghiên cứu	73
<i>Giới thiệu chương 4</i>	<i>73</i>
4.1. Mô hình thực nghiệm.....	74
4.1.1. Các yếu tố tác động đến tham nhũng.....	74
4.1.2. Tác động của tham nhũng đến tăng trưởng	75
4.2. Phương pháp ước lượng	76
4.2.1. Mô hình các thành phần sai số cố định.....	76
4.2.2. Mô hình các thành phần sai số ngẫu nhiên	77
4.2.3. Ước lượng bình phương tối thiểu tổng quát (GLS).....	78
4.2.4. Ước lượng với biến công cụ	79
4.2.5. Phương pháp ước lượng D-GMM	80
4.3. Các bước phân tích dữ liệu	82
4.3.1. Kiểm định các yếu tố tác động đến tham nhũng.....	83
4.3.2. Kiểm định hiệu ứng phi tuyến giữa thu nhập và tham nhũng	84
4.3.3 Kiểm định lý thuyết chất bôi trơn của tham nhũng	85
4.4. Dữ liệu nghiên cứu	86
4.4.1. Mô tả biến	86

4.4.2. Thống kê mô tả dữ liệu nghiên cứu	93
<i>Kết luận chương 4</i>	106
Chương 5 Kết quả nghiên cứu và thảo luận	108
<i>Giới thiệu chương 5</i>	108
5.1. Kết quả kiểm định các yếu tố tác động đến tham nhũng	109
5.1.1. Kiểm định quan hệ nhân quả Granger	109
5.1.2. Phân tích mô hình tuyến tính cơ bản	113
5.1.3. Kiểm tra tính vững của mô hình	124
5.1.4. Phân tích hiệu ứng từng phần	127
5.2. Kết quả kiểm định mối quan hệ phi tuyến	131
5.2.1. Mối quan hệ phi tuyến	131
5.2.2. Kiểm tra tính vững	135
5.3. Kết quả kiểm định hiệu ứng chất bôi trơn của tham nhũng ..	137
5.3.1. Kiểm định giả thuyết hiệu ứng hội tụ	137
5.3.2. Kết quả thực nghiệm mô hình cơ sở.....	139
5.3.3. Kết quả thực nghiệm mô hình biến tương tác	147
5.3.4. Phân tích tính vững bằng phương pháp D-GMM.....	150
Kết luận chương 5	153
Chương 6 Kết luận và hàm ý chính sách	154
<i>Giới thiệu chương 6</i>	154
6.1. Các phát hiện chính	154
6.2. Gợi ý về chính sách	156
6.2.1. Các giải pháp góp phần kiểm soát tham nhũng.....	156
6.2.2. Các giải pháp cho tăng trưởng kinh tế.....	164