

Vốn xã hội và nền kinh tế ngầm: phân tích Bayes về BRICS

Tien Ha My Duong

Khoa Kinh tế và Quản lý Công, Đại học Mở Thành phố Hồ Chí Minh, Thành phố Hồ Chí Minh, Việt Nam,

Nguyễn Thị Anh Như và Nguyễn Văn Điệp

Khoa Tài chính Ngân hàng, Đại học Mở Thành phố Hồ Chí Minh, Thành phố Hồ Chí Minh Thành phố, Việt Nam

Tóm tắt

Mục đích – Bài viết nhằm kiểm tra tác động của vốn xã hội đối với quy mô của nền kinh tế ngầm ở các quốc gia BRICS trong giai đoạn 1995–2014.

Thiết kế/phương pháp/cách tiếp cận – Các tác giả sử dụng phương pháp hồi quy tuyến tính Bayesian để khám phá mối quan hệ giữa vốn xã hội và nền kinh tế ngầm. Phương pháp này áp dụng phân phối chuẩn cho phân phối xác suất trước trong khi phân phối sau được xác định bằng cách sử dụng kỹ thuật Monte Carlo chuỗi Markov.

Kết quả – Kết quả chỉ ra rằng tỷ lệ thất nghiệp và gánh nặng thuế ảnh hưởng tích cực đến quy mô của nền kinh tế ngầm. Ngược lại, kiểm soát tham nhũng và mở cửa thương mại có tác động tiêu cực đến sự phát triển của khu vực phi chính thức này. Hơn nữa, phát hiện chính của bài báo là vốn xã hội được thể hiện bằng niềm tin xã hội và tinh thần thuế có thể cản trở quy mô của nền kinh tế ngầm.

Hạn chế/ý nghĩa của nghiên cứu – Nghiên cứu này chỉ giới hạn trong trường hợp của các nước BRICS trong giai đoạn 1995–2014. Các yếu tố quyết định nền kinh tế phi chính thức ở các nhóm quốc gia khác nhau có thể không đồng nhất. Hơn nữa, vốn xã hội là một khái niệm đa chiều có thể bao gồm nhiều thành phần khác nhau. Khó khăn trong việc đo lường vốn xã hội này đòi hỏi phải nghiên cứu sâu hơn về mối quan hệ giữa các khía cạnh khác của vốn xã hội và nền kinh tế phi chính thức.

Tính mới/giá trị – Nhiều nghiên cứu điều tra tác động của các yếu tố kinh tế đối với quy mô của nền kinh tế ngầm. Bài viết này áp dụng một cách tiếp cận mới để khám phá vấn đề. Đáng chú ý, các tác giả sử dụng phương pháp hồi quy tuyến tính Bayesian để phân tích mối quan hệ giữa vốn xã hội và nền kinh tế phi chính thức ở các nước BRICS.

Từ khóa Cách tiếp cận Bayesian, BRICS, Kinh tế ngầm, Vốn xã hội

Tài liệu tham khảo

Aidt, T.S. (2003), “*Economic analysis of corruption: a survey*”, The Economic Journal, Vol. 113 No. 491, pp. F632-F652.

Arrow, K.J. (1970), “Political and economic evaluation of social effects and externalities”, in Margolis, J. (Ed.), *The Analysis of Public Output*, National Bureau of Economic Research, Cambridge, MA, pp. 1-30.

Arrow, K.J. (1973), “*Social responsibility and economic efficiency*”, Public Policy, Vol. 21 No. 3, pp. 303-317.

Arrow, K.J. (1999), “Observations on social capital”, in Serageldin, I. and Dasgupta, P. (Eds), *Social Capital: A Multifaceted Perspective*, World Bank, Washington, DC, pp. 3-5.

Asea, P.K. (1996), “*The informal sector: baby or bath water? a comment*”, Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy, Vol. 45, pp. 163-171.

- Baklouti, N. and Boujelbene, Y. (2019), “*Kinh tế ngầm, corruption, and economic growth: an empirical analysis*”, *The Review of Black Political Economy*, Vol. 47 No. 3, pp. 276-294.
- Birinci, S. (2013), “*Độ mở thương mại, growth, and informality: panel VAR evidence from OECD economies*”, *Economics Bulletin*, Vol. 33 No. 1, pp. 694-705.
- Bjørnskov, C. (2010), “*How does Niềm tin xã hội lead to better governance? An attempt to separate electoral and bureaucratic mechanisms*”, *Public Choice*, Vol. 144 No. 1, pp. 323-346.
- Buehn, A. and Schneider, F. (2012), “*Corruption and the Kinh tế ngầm: like oil and vinegar, like water and fire?*”, *International Tax and Public Finance*, Vol. 19 No. 1, pp. 172-194.
- Cowles, M.K. and Carlin, B.P. (1996), “*Markov chain Monte Carlo convergence diagnostics: a comparative review*”, *Journal of the American Statistical Association*, Vol. 91 No. 434, pp. 883-904.
- Dell'Anno, R. (2007), “*The Kinh tế ngầm in Portugal: an analysis with the MIMIC approach*”, *Journal of Applied Economics*, Vol. 10 No. 2, pp. 253-277.
- D'Hernoncourt, J. and Méon, P.G. (2012), “*The not so dark side of trust: does trust increase the size of the Kinh tế ngầm?*”, *Journal of Economic Behavior and Organization*, Vol. 81 No. 1, pp. 97-121.
- Engel, C. (2011), “*Dictator games: a meta study*”, *Experimental Economics*, Vol. 14 No. 4, pp. 583-610.
- Enste, D.H. (2010), “*Kinh tế ngầm – the impact of regulation in OECD-countries*”, *International Economic Journal*, Vol. 24 No. 4, pp. 555-571.
- Fehr, E. and Schmidt, K. (1999), “*A theory of fairness, competition, and cooperation*”, *The Quarterly Journal of Economics*, Vol. 114 No. 3, pp. 817-868.
- Feld, L.P. and Frey, S.B. (2007), “*Tax compliance as the result of a psychological tax contact: the role of in-centives and responsive regulation*”, *Law and Policy*, Vol. 29 No. 1, pp. 102-120.
- Fugazza, M. and Fiess, N. (2010), “*Trade liberalization and informality: new stylized facts*”, Working Paper [No. 44], United Nations Conference on Trade and Development, United Nations, New York and Geneva, 1 March.
- Gelman, A. and Rubin, D.B. (1992), “*Inference from iterative simulation using multiple sequences*”, *Statistical Science*, Vol. 7 No. 4, pp. 457-472.
- Goel, R.K., Saunoris, J.W. and Schneider, F. (2019), “*Growth in the shadows: effect of the Kinh tế ngầm on US economic growth over more than a century*”, *Contemporary Economic Policy*, Vol. 37 No. 1, pp. 50-67.
- Heywood, P.M. (2014), *Routledge Handbook of Political Corruption*, Routledge, Abingdon, Oxon.
- Houser, D. and McCabe, K. (2014), “*Experimental economics and experimental game theory*”, in Glimcher, P.W. and Fehr, E. (Eds), *Neuroeconomics: Decision Making and the Brain*, 2nd ed., Academic Press, pp. 19-34.
- Ishak, P.W. and Farzanegan, M.R. (2020), “*The impact of declining oil rents on tax revenues: does the Kinh tế ngầm matter?*”, *Energy Economics*, Vol. 92, p. 104925.
- Kodila-Tedika, O. and Mutascu, M. (2014), “*Kinh tế ngầm and tax revenue in Africa*”, *Economics Bulletin*, Vol. 34 No. 1, pp. 469-479.

- Kruschke, J.K., Aguinis, H. and Joo, H. (2012), “*The time has come: Bayesian methods for data analysis in the organizational sciences*”, *Organizational Research Methods*, Vol. 15 No. 4, pp. 722-752.
- Lee, D. (2013), “*How does social capital reduce the size of the Kinh tế ngầm?*”, *Global Economic Review*, Vol. 42 No. 3, pp. 251-268.
- Lemoine, N.P. (2019), “*Moving beyond noninformative priors: why and how to choose weakly informative priors in Bayesian analyses*”, *Oikos*, Vol. 128 No. 7, pp. 912-928.
- Leonardi, R., Nanetti, R.Y. and Putnam, R.D. (2001), *Making Democracy Work: Civic Traditions in Modern Italy*, Princeton University Press, New Jersey.
- Mauleón, I. and Sardà, J. (2017), “*Thất nghiệp and the Kinh tế ngầm*”, *Applied Economics*, Vol. 49 No. 37, pp. 3729-3740.
- Mazhar, U. and Méon, P.G. (2017), “*Taxing the unobservable: the impact of the Kinh tế ngầm on inflation and taxation*”, *World Development*, Vol. 90, pp. 89-103.
- Medina, L. and Schneider, F.G. (2019), “*Shedding light on the Kinh tế ngầm: a global database and the interaction with the official one*”, Working Paper [No. 7981], Center for Economic Studies and ifo Institute, Munich.
- Nguyen, D.V. and Duong, M.T.H. (2021), “*Kinh tế ngầm, corruption and economic growth: an analysis of BRICS countries*”, *Journal of Asian Finance, Economics and Business*, Vol. 8 No. 4, pp. 665-672.
- Nguyen, V.D. and Duong, T.H.M. (2022), “*Corruption, Kinh tế ngầm, FDI, and tax revenue in BRICS: a Bayesian approach*”, *Montenegrin Journal of Economics*, Vol. 18 No. 2, pp. 55-64.
- Oanh, T.T.K., Diep, N.V., Truyen, P.T. and Chau, N.X.B. (2022), “*The impact of public expenditure on economic growth of provinces and cities in the Southern Key Economic Zone of Vietnam: Bayesian approach*”, in Ngoc Thach, N., Ha, D.T., Trung, N.D. and Kreinovich, V. (Eds), *Prediction and Causality in Econometrics and Related Topics*, Springer, Cham.
- Roberts, G.O. and Rosenthal, J.S. (2001), “*Optimal scaling for various Metropolis-Hastings algorithms*”, *Statistical Science*, Vol. 16 No. 4, pp. 351-367.
- Schneider, F. (2005), “*Shadow economies around the world: what do we really know?*”, *European Journal of Political Economy*, Vol. 21 No. 3, pp. 598-642.
- Schneider, F., Raczkowski, K. and Mróz, B. (2015), “*Kinh tế ngầm and tax evasion in the EU*”, *Journal of Money Laundering Control*, Vol. 18 No. 1, pp. 34-51.
- Smith, P. (1994), “*Assessing the size of the underground economy: the Canadian statistical perspectives*”, Working Paper [No. 28], Statistics Canada, Ottawa.
- Thach, N.N. (2021), “*How values influence economic progress? Evidence from South and southeast asian countries*”, in Ngoc Thach, N., Kreinovich, V. and Trung, N.D. (Eds), *Data Science for Financial Econometrics*, Springer, Cham, pp. 207-221.
- Thaler, R.H. (2000), “*From Homo economicus to Homo sapiens*”, *Journal of Economic Perspective*, Vol. 14 No. 1, pp. 133-141.
- Torgler, B. (2003), “*Thuế đạo đức, rule-governed behaviour and trust*”, *Constitutional Political Economy*, Vol. 14 No. 2, pp. 119-140.
- Torgler, B. and Schneider, F. (2009), “*The impact of Thuế đạo đức and institutional quality on the Kinh tế ngầm*”, *Journal of Economic Psychology*, Vol. 30 No. 2, pp. 228-245.

Williams, C.C. and Horodnic, I.A. (2015), “*Explaining and tackling the Kinh tế ngầm in Estonia, Latvia and Lithuania: a Thuế đạo đức approach*”, *Baltic Journal of Economics*, Vol. 15 No. 2, pp. 81-98.

Lời cảm ơn

Bài báo này là một phần của phần đặc biệt “Lựa chọn xã hội và Kinh tế học hành vi (Lời tri ân tới KJ Arrow)”, khách mời do Giáo sư Vladik Kreinovich biên tập.

Tác giả liên hệ

Liên hệ tác giả tại email: diep.nv@ou.edu.vn