

KIỀU HỐI VÀ THAM NHŨNG: NGHIÊN CỨU THỰC NGHIỆM TẠI CÁC QUỐC GIA CHÂU Á THÁI BÌNH DƯƠNG

NGUYỄN PHÚC CẢNH

Trường Đại học Kinh tế Thành phố Hồ Chí Minh - canhnguyen@ueh.edu.vn

(Ngày nhận: 16/7/2016; Ngày nhận lại: 18/08/2016; Ngày duyệt đăng: 09/01/2017)

TÓM TẮT

Bài viết này sử dụng dữ liệu tại 29 quốc gia khu vực châu Á Thái Bình Dương trong giai đoạn 2002 – 2013 để kiểm tra tác động của kiều hối đến tình trạng tham nhũng của các quốc gia nhận kiều hối. Thông qua ước lượng dữ liệu bảng bằng mô hình GMM, chúng tôi phát hiện thấy rằng kiều hối làm trầm trọng thêm tình trạng tham nhũng của quốc gia nhận kiều hối, đồng thời tác động này mạnh hơn trong giai đoạn có khủng hoảng kinh tế.

Từ khóa: kiều hối; tham nhũng; châu Á Thái Bình Dương.

The impact of remittances on corruption: An empirical study in Asia Pacific countries

ABSTRACT

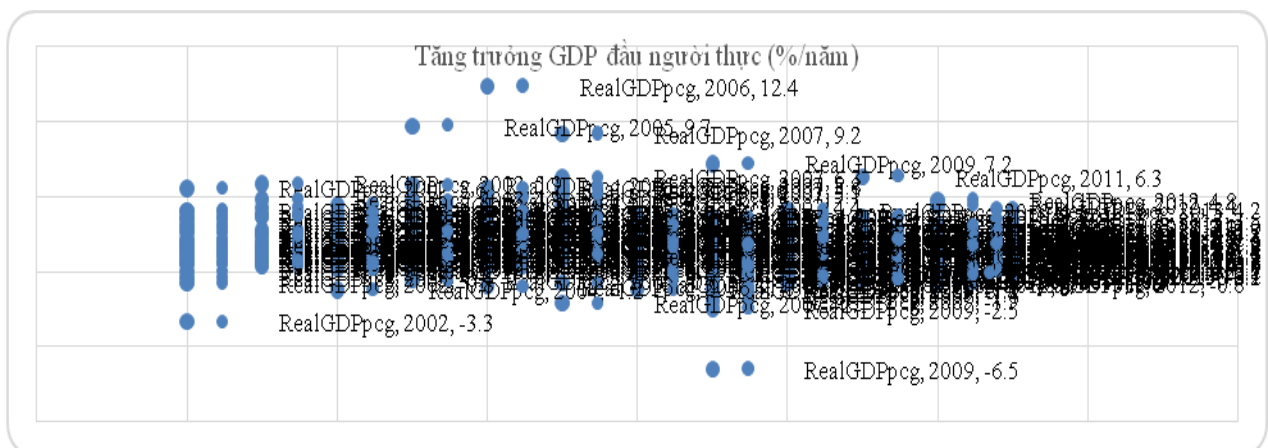
This paper uses data from 29 Asia Pacific countries over the period 2002 – 2013 to investigate the impact of remittances on corruption in these countries. By estimating parameters in GMM statistical model, we found that remittances exacerbate corruption in recipient countries and that the situation had worsened during the period of economic crisis.

Keywords: personal remittances; corruption; Asia Pacific.

1. Giới thiệu

Mặc dù đối mặt với khó khăn do khủng hoảng tài chính toàn cầu 2008 gây ra, song tăng trưởng kinh tế thực của 29 quốc gia khu vực châu Á Thái Bình Dương bao gồm: Afghanistan, Armenia, Australia, Azerbaijan, Bangladesh, Bhutan, Cambodia, China, Fiji, Georgia, Hong Kong SAR, China, India, Indonesia, Japan,

Kazakhstan, Korea, Kyrgyz Republic, Lào, Malaysia, Mongolia, Nepal, New Zealand, Pakistan, Philippines, Tajikistan, Thailand, Tonga, Vanuatu, và Việt Nam trong giai đoạn 2002 – 2013 tương đối cao và ổn định trong giai đoạn từ 2002 đến 2006, trước khi có sự suy giảm và biến động trong giai đoạn 2008 – 2010 và kéo dài đến những năm 2011 và 2012 (Hình 1).

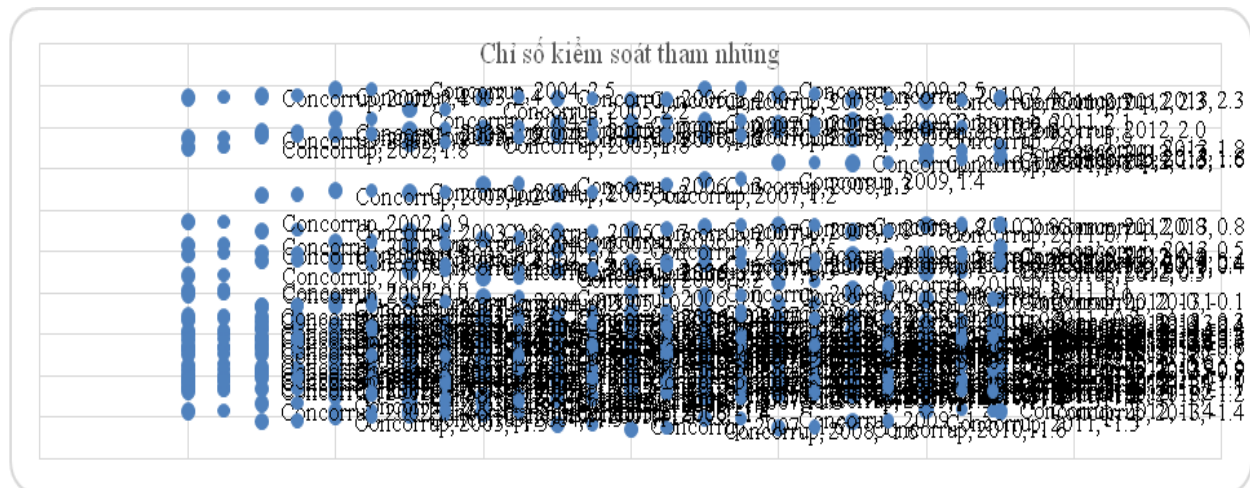


Hình 1. Tăng trưởng kinh tế tại 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương

Nguồn: tổng hợp từ báo cáo của ngân hàng thế giới.

Cùng với hiệu quả trong tăng trưởng kinh tế, các vấn đề về chất lượng thể chế như kiểm soát tham nhũng, hiệu quả của chính phủ, hiệu quả của hệ thống pháp luật cũng được đề cập

và xem xét trong nhiều nghiên cứu về khu vực này (Campos & Nugent, 1999; Fisman & Gatti, 2000; Kidd & Richter, 2003; Knack, 2006; Lee & Oh, 2007).



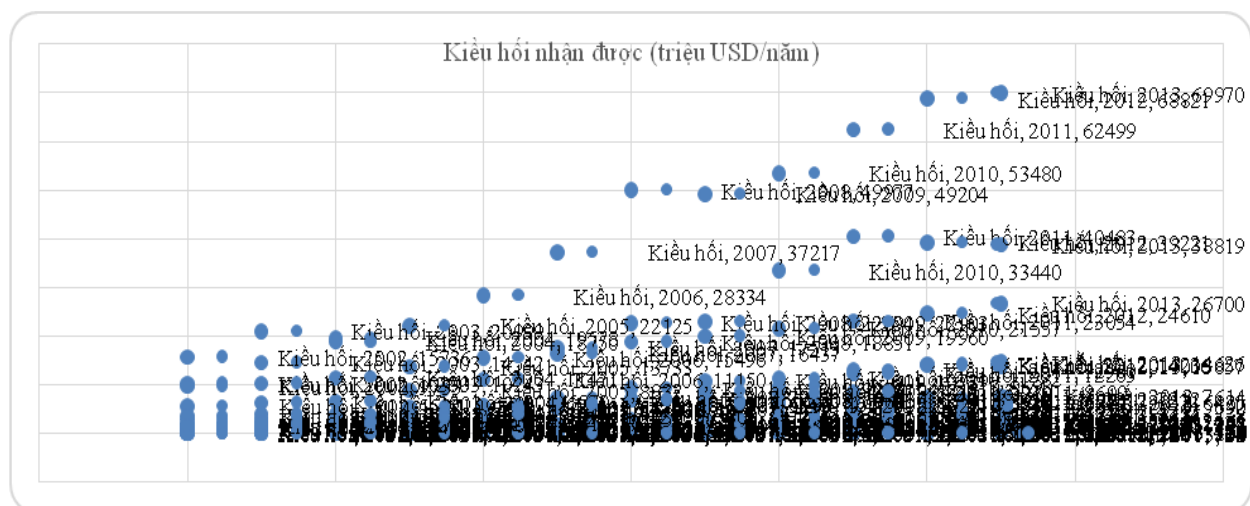
Hình 2. Chỉ số kiểm soát tham nhũng tại 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương

Nguồn: tổng hợp từ báo cáo của ngân hàng thế giới.

Tuy vậy, dữ liệu từ báo cáo World Governance Indicators của ngân hàng thế giới (worldbank) cho thấy rằng hiệu quả kiểm soát tham nhũng của các quốc gia trong khu vực còn thấp khi chỉ số kiểm soát tham nhũng (control of corruption) có giá trị tập trung ở mức dưới 0 (chỉ số của Worldbank tính toán có giá trị từ -2.5 đến 2.5, chỉ số càng cao thể hiện hiệu quả càng cao của công tác kiểm soát

tham nhũng của một quốc gia), trong khi đó tình trạng này không được cải thiện nhiều trong suốt hơn 10 năm qua (Hình 2).

Mặt khác, khu vực châu Á Thái Bình Dương bên cạnh dòng vốn đầu tư trực tiếp và gián tiếp nước ngoài (FDI và FPI) thì kiều hối cũng là nguồn cung vốn lớn cho nền kinh tế các quốc gia trong khu vực tạo thu nhập và nguồn vốn đầu tư của toàn xã hội (Hình 3, Bảng 1)



Hình 3. Kiều hối nhận được tại 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương

Nguồn: tổng hợp từ báo cáo của ngân hàng thế giới.

Bảng 1

Kiều hối nhận được của các nước năm 2002 và 2013

Nước	2002	2013
Afghanistan	104 ^a	538
Armenia	131	2192
Australia	1772	2465
Azerbaijan	182	1733
Bangladesh	2858	13857
Bhutan	2 ^b	12
Cambodia	140	176
China	10293	38819
Fiji	99	204
Georgia	230	1945
Hong Kong SAR, China	121	360
India	15736	69970
Indonesia	1259	7614
Japan	1821	2364
Kazakhstan	205	207
Korea, Rep.	5530	6425
Kyrgyz Republic	37	2278
Lao PDR	1	60
Malaysia	435	1396
Mongolia	56	256
Nepal	678	5552
New Zealand	1148	459
Pakistan	3554	14626
Philippines	9735	26700
Tajikistan	79	3626 ^c
Thailand	1380	5690
Tonga	66	112 ^c
Vanuatu	4	24
Vietnam	1770	8600 ^d

Ghi chú: a là số liệu năm 2008, b là số liệu năm 2006, c là số liệu năm 2012, và d là số liệu năm 2011

Nguồn: Báo cáo World Development Indicators.

Trong khi đó, các nghiên cứu cả về lý thuyết lẫn thực nghiệm dẫn đến kết luận rằng kiều hối có tác động đến nhiều yếu tố vĩ mô của nền kinh tế như thu nhập, đầu tư, tiêu dùng, chất lượng thể chế và cả tham nhũng (Abdih, Chami, Dagher, & Montiel, 2012; P. A. Acosta, Lartey, & Mandelman, 2009; Adams Jr & Cuecuecha, 2010, 2013; Adams Jr & Page, 2005; Aggarwal, Demirgüç-Kunt, & Pería, 2011; Ahmed, 2010, 2013; Anzoategui, Demirgüç-Kunt, & Martínez Pería, 2014; Bayangos & Jansen, 2011; Beine, Lodigiani, & Vermeulen, 2012; Berdiev, Kim, & Chang, 2013; Bettin & Zazzaro, 2012; Catrinescu, Leon-Ledesma, Piracha, & Quillin, 2009; Chowdhury, 2011; Combes & Ebeke, 2011). Do đó, nghiên cứu này sử dụng dữ liệu trong giai đoạn 2002 – 2013 tại 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương đã được đề cập ở trên để kiểm tra tác động của kiều hối lên tình trạng tham nhũng tại khu vực. Phần tiếp theo trình bày khung lý thuyết và phương pháp nghiên cứu được sử dụng.

2. Tổng hợp lý thuyết

Tác động của kiều hối đến các yếu tố vĩ mô của quốc gia nhận được xem xét dưới nhiều góc độ. Trước tiên, kiều hối bổ sung vào thu nhập của người dân nên gia tăng thu nhập khả dụng, từ đó tác động thúc đẩy tiêu dùng và đầu tư tư nhân (Adams Jr & Cuecuecha, 2010; Combes & Ebeke, 2011), sự gia tăng trong tiêu dùng và đầu tư tư nhân giúp gia tăng tổng cầu và kích thích tăng trưởng kinh tế (Catrinescu et al., 2009). Tuy nhiên, việc thu nhập của hộ gia đình gia tăng nên hành vi tiêu dùng của hộ gia đình có thể bị ảnh hưởng và thay đổi, thay vì dành thời gian lao động, hộ gia đình sẽ dành nhiều thời gian hơn cho tiêu dùng nên tạo áp lực làm giảm cung lao động khiến cho chi phí lao động tăng và gây ra ảnh hưởng tiêu cực lên nền kinh tế (P. A. Acosta et al., 2009; Bourdet & Falck, 2006).

Thứ hai, kiều hối còn được xem xét dưới góc độ giúp quốc gia nhận kiều hối đối phó với tình trạng nghèo đói, cải thiện chất lượng

cuộc sống của người dân thông qua tác động gia tăng thu nhập của người dân nhận kiều hối (P. Acosta, Calderón, Fajnzylber, & Lopez, 2008; Adams Jr & Cuecuecha, 2013; Adams Jr & Page, 2005; Gupta, Pattillo, & Wagh, 2009; Imai, Gaiha, Ali, & Kaicker, 2014). Theo đó, kiều hối giúp gia tăng thu nhập của người dân nên giúp giảm nghèo đói, đồng thời lượng kiều hối giúp gia tăng đầu tư tư nhân nên tăng năng suất, tạo việc làm cho người dân và giúp giảm nghèo đói (Adams Jr & Page, 2005; Gupta et al., 2009; Imai et al., 2014). Thứ ba, kiều hối còn có tác động đến tỷ giá làm gia tăng giá trị nội tệ, tạo áp lực lên cán cân thanh toán và dòng vốn đầu tư nước ngoài. Tác động này được xem là tiêu cực vì giảm sức cạnh tranh của hàng hóa nội địa nên ảnh hưởng tiêu cực đến tăng trưởng kinh tế (P. A. Acosta et al., 2009).

Bên cạnh các tác động của kiều hối đến các hoạt động và biến số của nền kinh tế thì kiều hối còn được nghiên cứu ảnh hưởng đến chất lượng của nền kinh tế thông qua chất lượng và sự phát triển của hệ thống tài chính, mà đặc biệt là chất lượng của thể chế (Abdih et al., 2012; Aggarwal et al., 2011; Ahmed, 2010, 2013; Beine et al., 2012; Berdiev et al., 2013; Bettin & Zazzaro, 2012). Nhiều nghiên cứu xem xét tác động của kiều hối đến sự phát triển và mở cửa của thị trường tài chính cho thấy dòng kiều hối tăng lên tạo động lực cho thị trường tài chính phát triển như phát triển sản phẩm, tạo tính minh bạch cho thị trường, mở cửa thị trường tài chính... từ đó tạo ra hiệu ứng tích cực giúp giảm các chi phí giao dịch, giảm bớt các rào cản tài chính và tạo ra cơ sở cho tăng trưởng kinh tế (Aggarwal et al., 2011; Anzoategui et al., 2014; Beine et al., 2012; Bettin & Zazzaro, 2012; Chowdhury, 2011; Coulibaly, 2015; Demirgüç-Kunt, Córdoba, Pería, & Woodruff, 2011).

Tuy vậy, kiều hối không chỉ có tác động tích cực hoàn toàn lên chất lượng thị trường tài chính hay nền kinh tế, kiều hối còn được phát hiện thấy có tác động tiêu cực lên tình trạng tham nhũng, một trong những yếu tố

quan trọng trong đánh giá chất lượng thể chế. Các nghiên cứu lý thuyết cho thấy kiểu hối có tác động đến chất lượng thể chế của quốc gia nhận theo đó kiểu hối giúp gia tăng thu nhập của người dân nên người dân có nhiều ngân sách hơn để tiêu thụ hàng hóa, trong đó có các hàng hóa và dịch vụ công (Abdih et al., 2012). Bởi vì người dân nhờ có kiểu hối mà có khả năng tiếp cận các hàng hóa và dịch vụ, đặc biệt hàng hóa và dịch vụ công dễ dàng hơn nên họ có ít động lực để kiểm soát các hoạt động của chính quyền hơn, đặc biệt là tham nhũng. Nhiều nghiên cứu cho thấy bằng chứng thực nghiệm về lập luận này như bằng chứng tại các quốc gia hồi giáo (Ahmed, 2013), hay bằng chứng tại hơn 111 quốc gia trong đó bao gồm cả những quốc gia phát triển và đang phát triển (Berdiev et al., 2013), thậm chí tại các quốc gia ngoài nhóm OECD kiểu hối còn làm gia tăng tình trạng tham nhũng mạnh hơn.

Tuy nhiên, theo cách nhìn thứ hai về tác động của kiểu hối lên chất lượng thể chế qua tình trạng tham nhũng thì lập luận rằng khi kiểu hối tăng lên tạo ra mức thu nhập cao hơn, kích thích đầu tư và tiêu dùng giúp tăng trưởng kinh tế, đồng thời giúp phát triển chất lượng của các loại thị trường mà đặc biệt là thị trường tài chính nên giúp gia tăng tính minh bạch và chất lượng thể chế từ đó giúp hạn chế tham nhũng (Catrinescu et al., 2009). Có thể thấy rõ ràng rằng kiểu hối tạo ra áp lực lớn hơn cho sự phát triển của thị trường tài chính vì nhu cầu đầu tư vốn lớn hơn do nguồn kiểu hối tạo ra, từ đó tạo áp lực cho phát triển hệ thống pháp luật liên quan, hệ thống thông tin kinh tế của quốc gia và đặc biệt là chất lượng dịch vụ công của các quốc gia nhận kiểu hối, do đó giúp giảm tình trạng tham nhũng cũng như nâng cao chất lượng thể chế của quốc gia nhận kiểu hối. Như vậy, tác động của kiểu hối lên tình trạng tham nhũng phụ thuộc vào mức độ tác động và hành vi của người dân cũng như sự thay đổi trong thị trường dẫn đến tác động khác nhau. Phần tiếp theo trình bày phương pháp nghiên cứu trong

bài viết này.

3. Phương pháp nghiên cứu

3.1. Mô hình nghiên cứu

Để kiểm định tác động của kiểu hối lên tình trạng tham nhũng của 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương, bài viết sử dụng mô hình được trình bày trong nghiên cứu của Berdiev et al. (2013) có dạng:

$$\Delta \text{Concorrup}_{it} = a_0 + a_1 \text{Concorrup}_{it-1} + a_2 \text{Logre}_{it} + a_3 \text{LogGDPPC}_{it} + a_4 \text{LogFDI}_{it} + a_5 \text{Vix} + e_{it} \quad (1)$$

Trong đó *Concorrup* là biến đại diện cho hiệu quả kiểm soát tham nhũng của một quốc gia (chỉ số càng cao, tham nhũng càng thấp), trong mô hình này chúng tôi sử dụng thay đổi trong chỉ số kiểm soát tham nhũng (Control of Corruption) để xem xét sự thay đổi trong chất lượng kiểm soát tham nhũng của các quốc gia; *Logre* là biến đại diện cho kiểu hối, *LogGDPPC* và *LogFDI* là các biến kiểm soát đại diện cho mức thu nhập của từng quốc gia và dòng vốn trực tiếp nước ngoài vào. Trong đó, các quốc gia có mức thu nhập cao hơn thường sẽ có xã hội dân chủ phát triển hơn do đó tình trạng tham nhũng thấp hơn, đồng thời đó dòng vốn FDI vào sẽ tạo áp lực cải thiện chất lượng thể chế đồng thời minh bạch thông tin cho các nhà đầu tư nước ngoài nên tình trạng tham nhũng cũng giảm đi (Gyimah-Brempong, 2002; Habib & Zurawicki, 2002; Kwok & Tadesse, 2006). Trong nghiên cứu này, ngoài sử dụng các biến kiểm soát theo mô hình gốc, chúng tôi sử dụng thêm biến *Vix* đo lường độ biến động tiềm ẩn của hợp đồng quyền chọn trên chỉ số S&P 500 được thu thập từ Yahoo finance để đo lường tác động của khủng hoảng lên các mối quan hệ được xem xét. Bởi vì giai đoạn nghiên cứu của bài viết là 2002 – 2013 do đó sẽ bị ảnh hưởng của khủng hoảng tài chính toàn cầu năm 2008, tuy nhiên để kiểm định thay đổi của các mối quan hệ qua hai giai đoạn trước và sau khủng hoảng chúng ta có thể sử dụng phương pháp tách dữ liệu thành hai nhóm. Nhưng vì dữ liệu tương đối ngắn đồng thời hạn chế về số lượng nước do đó tách thành hai giai đoạn sẽ gặp rủi ro về ước lượng không có

tính bền vững, do đó chúng tôi sử dụng biến Vix đại diện cho khủng hoảng, trong đó những năm khủng hoảng chỉ số Vix tăng cao hơn so với những năm kinh tế thế giới không có khủng hoảng. Đã có những nghiên cứu sử

dụng chỉ số này để đại diện cho khủng hoảng và cho thấy kết quả phù hợp (Druck, Magud, & Mariscal, 2015). Định nghĩa và nguồn thu thập dữ liệu cho các biến được trình bày ở Bảng 2.

Bảng 2

Định nghĩa và nguồn thu thập các biến

Biến	Định nghĩa	Nguồn
Concorrup	Chỉ số đo lường hiệu quả kiểm soát tham nhũng	World Governance Indicators
Logre	Logarith tổng giá trị khiếu hối nhận được	Tính từ World Development Index
Loggdppc	Logarith GDP đầu người	Tính từ World Development Index
Logfdiin	Logarith FDI vào ròng	Tính từ World Development Index
Vix	Chỉ số đo lường độ biến động ẩn của hợp đồng quyền chọn trên chỉ số S&P 500	Yahoo finance

Trong nghiên cứu này, khi sử dụng dữ liệu bảng cho 29 quốc gia thuộc khu vực châu Á Thái Bình Dương trong giai đoạn 2002 – 2013 nên khi ước lượng mô hình bài viết đưa thêm biến trễ của biến kiểm soát tham nhũng vào nhằm xử lý hiện tượng tự tương quan trong dữ liệu bảng (Arellano, 2003; Baltagi, Song, Jung, & Koh, 2007). Với dữ liệu bảng cho nhiều quốc gia trong khu vực có thể hiện tượng phương sai thay đổi sẽ tồn tại, đồng thời đó các biến như tình trạng tham nhũng, vốn đầu tư nước ngoài, hay khiếu hối sẽ có mối quan hệ tương hỗ (Ahmed, 2010; Berdiev et al., 2013), do đó sẽ tồn tại hiện tượng nội sinh nếu sử dụng các kỹ thuật ước lượng như OLS, FEM và REM cho dữ liệu bảng. Để xử lý hiện tượng nội sinh trong dữ

liệu bảng, bài viết sử dụng kỹ thuật ước lượng GMM được phát triển bởi các nhà nghiên cứu Arellano and Bond (1991) và sau đó là Arellano and Bover (1995). Phần tiếp theo trình bày mô tả thống kê dữ liệu sử dụng trong bài viết này.

3.2. Dữ liệu nghiên cứu

Mô tả thống kê dữ liệu bởi Bảng 3 cho thấy rõ ràng chất lượng kiểm soát tham nhũng của 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương còn thấp, chỉ số trung bình đạt -0.254 chứng tỏ tình trạng tham nhũng trong khu vực còn tương đối cao, đồng thời đó độ lệch chuẩn cũng có giá trị trên 1 chứng tỏ rằng có sự khác biệt trong chất lượng kiểm soát tham nhũng giữa 29 quốc gia được nghiên cứu, điều này cũng thể hiện rõ trong Hình 2 ở trên.

Bảng 3

Mô tả thống kê dữ liệu

Biến	N	Trung bình	Độ lệch chuẩn	Nhỏ nhất	Lớn nhất
Concorrup	348	-0.254	1.014	-1.637	2.462
Logre	334	8.907	0.990	5.863	10.845
Loggdppc	348	3.319	0.621	2.365	4.575
Logfdiin	348	8.739	1.950	0.000	11.541
Vix	348	20.866	6.491	12.550	31.793

Nguồn: tính toán của tác giả.

Xem xét giữa hai dòng vốn: FDI và kiều hối thì FDI có độ biến động lớn hơn vì độ lệch chuẩn của chỉ số này cao hơn nhiều so với độ lệch chuẩn của kiều hối chứng tỏ dòng kiều

hối vào các quốc gia trong khu vực có tính ổn định hơn. Sử dụng kiểm định t-test để kiểm tra hệ số tương quan giữa các biến, kết quả được trình bày ở Bảng 4.

Bảng 4

Hệ số tương quan giữa các biến

Hệ số tương quan	Concorrup	Logre	Loggdppc	Logfdiin
Concorrup	1.000			
Logre	-0.041 0.458	1.000		
Loggdppc	0.850*** 0.000	0.029 0.600	1.000	
Logfdiin	0.070 0.192	0.345*** 0.000	0.223*** 0.000	1.000

*, **, *** tương ứng với mức ý nghĩa 10%, 5% và 1%

Nguồn: tính toán của tác giả.

Hệ số tương quan giữa các biến cho thấy rằng dường như trong ngắn hạn kiều hối không có tác động đến tình trạng tham nhũng, trong khi đó những quốc gia có thu nhập bình quân đầu người càng cao sẽ có tình trạng kiểm soát tham nhũng tốt hơn. Để kiểm tra chính xác tác động của kiều hối lên tình trạng tham nhũng của các quốc gia trong khu vực, phần tiếp theo trình bày kết quả ước lượng có được từ mô hình GMM.

4. Kết quả nghiên cứu và thảo luận

Kết quả ước lượng cho 29 quốc gia khu

vực châu Á Thái Bình Dương trong giai đoạn 2002 – 2013 được trình bày ở Bảng 5 và Bảng 6. Chúng tôi sử dụng ước lượng GMM hệ thống (sys-GMM) để giải quyết hiện tượng nội sinh trong mô hình dữ liệu bảng động trong thời gian ngắn và không cân bằng. Kiểm tra tính bền vững của ước lượng GMM hệ thống bằng AR(2) và Hansen và Sargan test, chúng tôi thấy rằng các kiểm định này đều không có ý nghĩa thống kê có nghĩa rằng mô hình GMM hệ thống là phù hợp vì không bị tự tương quan bậc 2 và các biến công cụ là phù hợp.

Bảng 5

Kiều hối và tham nhũng

Dconcorrup	1		2	
	GMM		GMM	
	Coff	P-value	Coff	P-value
Concorrup(-1)	-0.167***	0.000	-0.106***	0.000
Logre	-0.011**	0.045	-0.015*	0.057
Loggdppc	0.244***	0.000	0.148***	0.000
Logfdiin			0.010***	0.000
C	-0.751***	0.000	-0.475***	0.000
N	307		280	
Số quốc gia	29		29	
AR(2) test	1.43	0.152	1.41	0.159
Sargan test	35.66	0.152	44.46	0.131
Hansen test	28.34	0.446	27.24	0.823

*, **, *** tương ứng với mức ý nghĩa 10%, 5% và 1%

Nguồn: tính toán của tác giả.

Trước hết, biến *Concorrup* kỳ trước có tác động âm lên thay đổi trong *Concorrup* của kỳ này cho thấy rằng tình trạng tham nhũng tại các quốc gia, hay hiệu quả kiểm soát tham nhũng của 29 quốc gia châu Á Thái Bình Dương có tính hội tụ. Những quốc gia có tình trạng kiểm soát tốt tham nhũng (chỉ số *Concorrup* kỳ trước cao) sẽ có tốc độ thay đổi trong tình trạng kiểm soát tham nhũng kỳ này thấp hơn và ngược lại những quốc gia có chỉ số kiểm soát tham nhũng kỳ trước thấp sẽ có thay đổi trong hiệu quả kiểm soát kỳ này cao hơn, do đó hiệu quả kiểm soát tham nhũng giữa các quốc gia sẽ có tính hội tụ. Kết quả này hoàn toàn hợp lý bởi với những quốc gia có tình trạng kiểm soát tham nhũng tốt, việc gia tăng các biện pháp kiểm soát tham nhũng thêm thì hiệu quả chắc chắn sẽ kém hơn những quốc gia đang kém hiệu quả trong kiểm soát tham nhũng. Kết quả này còn cho thấy rằng chất lượng thể chế của các quốc gia châu Á Thái Bình Dương sẽ có xu hướng hội tụ lại với nhau.

Tiếp đến, biến nghiên cứu *Logre* có tác động âm có ý nghĩa thống kê lên biến phụ thuộc cho thấy rằng khi đồng kiều hối tăng lên làm giảm chỉ số *Concorrup* có nghĩa rằng làm giảm hiệu quả kiểm soát lạm phát tại các quốc gia nhận kiều hối. Kết quả này cho thấy rằng kiều hối đã có tác động tích cực lên thu nhập của người dân, từ đó tạo cơ sở cho người dân có nhiều thu nhập hơn để chi tiêu cũng là cơ sở để tình trạng tham nhũng gia tăng. Kết quả này cũng dễ hiểu bởi tình trạng tham nhũng

cao tại khu vực châu Á Thái Bình Dương, đi đôi với vấn đề này là tình trạng dân trí còn thấp, kèm với các đặc điểm khác của thể chế chưa phát triển do đó khi thu nhập của người dân có được từ nguồn kiều hối cao hơn sẽ tạo cơ hội cho tham nhũng cao hơn.

Với các biến kiểm soát khác như mức thu nhập đầu người thực, dòng vốn FDI đều cho kết quả tác động dương có ý nghĩa thống kê lên hiệu quả kiểm soát tham nhũng chứng tỏ rằng tại các quốc gia có mức thu nhập đầu người cao hơn thì hiệu quả kiểm soát tham nhũng tốt hơn. Kết quả này cũng dễ hiểu bởi thu nhập cao đi đôi với tình trạng nền kinh tế phát triển hơn, thể chế tốt hơn, đồng thời dân trí cao hơn do đó hiệu quả kiểm soát tham nhũng tốt hơn. Trong khi đó, dòng vốn đầu tư trực tiếp nước ngoài giúp tăng tính minh bạch và tạo ra nhiều áp lực để các chính phủ thay đổi thể chế, cải thiện chất lượng chính quyền và kiểm soát lạm phát tốt hơn.

Như đã phân tích ở trên, khủng hoảng 2008 có tác động mạnh đến các yếu tố vĩ mô của các quốc gia trong khu vực, điều này dẫn đến nhu cầu kiểm tra tác động của khủng hoảng đến mối quan hệ giữa kiều hối và tham nhũng. Trong bước tiếp theo, bài viết sử dụng chỉ số Vix đã trình bày ở trên để ước lượng tác động của khủng hoảng đến hiệu quả tham nhũng, đồng thời sử dụng biến tương tác giữa chỉ số Vix và biến *Logre* để kiểm tra tác động của khủng hoảng trong tương tác với biến kiều hối lên tham nhũng, kết quả được trình bày ở Bảng 6 với hai mô Hình 3 và 4.

Bảng 6

Kiều hối, tham nhũng và khủng hoảng tài chính toàn cầu 2008

Dconcorrup	3		4	
	GMM		GMM	
	Coff	P-value	Coff	P-value
Concorrup(-1)	-0.116***	0.000	-0.126***	0.000
Logre	-0.021***	0.008	0.145***	0.002
Loggdppc	0.161***	0.000	0.177***	0.000
Logfdiin	0.011***	0.000	0.010***	0.001

Dconcorrup	3		4	
	GMM		GMM	
	Coff	P-value	Coff	P-value
Vix	-0.001*	0.100	0.069***	0.000
Logre*Vix			-0.008***	0.000
C	-0.458***	0.000	-2.004***	0.000
N	276		276	
Số quốc gia	29		29	
AR(2) test	1.44	0.151	1.42	0.156
Sargan test	44.56	0.129	38.61	0.310
Hansen test	24.97	0.895	25.89	0.868

*, **, *** tương ứng với mức ý nghĩa 10%, 5% và 1%

Nguồn: tính toán của tác giả.

Kết quả ước lượng trong mô Hình 3 cho thấy rằng khi khủng hoảng xảy ra (chỉ số Vix tăng) sẽ làm giảm chỉ số Concorrup tức là làm giảm hiệu quả kiểm soát tham nhũng tại khu vực. Điều này cho thấy rằng trong giai đoạn khủng hoảng kinh tế, hệ thống các nhân viên thuộc chính quyền và hệ thống thể chế xấu đi nghiêm trọng dẫn đến tình trạng tham nhũng cao hơn. Kết quả này cho thấy vấn đề nghiêm trọng trong khu vực trong việc giải quyết và đối phó với khủng hoảng, vì trong giai đoạn khủng hoảng chất lượng thể chế càng suy giảm. Kết quả này cũng dễ hiểu bởi trong giai đoạn khủng hoảng, hệ thống chính quyền sẽ gặp khó khăn hơn trong các khoản thu, đồng thời đó thu nhập của người làm việc trong các khu vực nhà nước suy giảm nên các hành vi tham nhũng có thể diễn ra nhiều hơn.

Trong khi đó, kết quả ước lượng trong mô Hình 4 ở Bảng 6 với biến tương tác giữa kiều hối và khủng hoảng cho tác động âm lên chỉ số kiểm soát tham nhũng cho thấy rằng trong giai đoạn khủng hoảng nếu dòng kiều hối tăng lên sẽ càng làm tình trạng tham nhũng diễn ra trầm trọng hơn. Kết quả này cũng dễ hiểu bởi trong giai đoạn khủng hoảng khi dòng kiều hối gia tăng sẽ gia tăng thu nhập của người dân và tình trạng tham nhũng sẽ dễ dàng hơn do đó các nhân viên làm việc trong khu vực nhà nước sẽ có những hành vi tham nhũng

nhiều hơn. Trong khi đó, biến đại diện cho kiều hối thay đổi dấu so với ba mô hình trước từ âm chuyển thành dương cho thấy rằng trong giai đoạn kinh tế ổn định, kiều hối sẽ làm tăng hiệu quả kiểm soát tham nhũng của các quốc gia châu Á Thái Bình Dương, còn trong giai đoạn khủng hoảng kiều hối sẽ làm tăng tình trạng tham nhũng của các quốc gia này. So sánh với các ước lượng ở ba mô hình trước cũng dẫn đến kết luận rằng tác động âm lên hiệu quả kiểm soát tham nhũng của kiều hối trong giai đoạn khủng hoảng là mạnh hơn tác động dương của chính nó trong giai đoạn kinh tế ổn định nên trong cả giai đoạn 2002 – 2013 kiều hối có tác động âm lên hiệu quả kiểm soát tham nhũng của các quốc gia châu Á Thái Bình Dương.

5. Kết luận và gợi ý chính sách

5.1. Kết luận

Thông qua kỹ thuật ước lượng GMM cho dữ liệu bảng của 29 quốc gia khu vực châu Á Thái Bình Dương trong giai đoạn 2002 – 2013 để xem xét tác động của kiều hối lên tình trạng tham nhũng trong khu vực chúng tôi rút ra một số kết luận sau:

Thứ nhất, kiều hối có tác động tiêu cực lên khả năng kiểm soát tham nhũng của quốc gia nhận kiều hối, có nghĩa rằng dòng kiều hối tăng lên làm tăng tham nhũng và giảm chất lượng thể chế của quốc gia nhận. Kết quả này

phù hợp với lý thuyết và các nghiên cứu thực nghiệm trước đó, khi dòng kiều hối tăng lên do hiệu ứng thu nhập tăng nên người dân có khả năng tiếp cận các dịch vụ công dễ dàng hơn nên họ không có nhiều động lực để kiểm soát tình trạng tham nhũng do đó tham nhũng thêm trầm trọng.

Thứ hai, bên cạnh đó hiệu quả kiểm soát giữa 29 quốc gia trong khu vực có xu hướng hội tụ, chất lượng kiểm soát tham nhũng của những quốc gia có thu nhập cao hơn thì tốt hơn những quốc gia có mức thu nhập thấp hơn. Đồng thời dòng vốn đầu tư trực tiếp nước ngoài cũng tạo áp lực để các quốc gia cải thiện hiệu quả kiểm soát tham nhũng.

Thứ ba, khủng hoảng tài chính toàn cầu 2008 làm trầm trọng thêm tình trạng tham nhũng, đặc biệt trong giai đoạn khủng hoảng nếu dòng kiều hối tăng lên thì tình trạng tham nhũng càng mạnh hơn.

5.2. Gợi ý chính sách

Qua kết quả nghiên cứu, bài viết rút ra

một số gợi ý chính sách mà các quốc gia có nhận kiều hối như Việt Nam cần quan tâm giải quyết:

Một là, đi đôi với chính sách thu hút kiều hối, các quốc gia này phải nâng cao hiệu quả công tác phòng chống tham nhũng để dòng kiều hối đi vào sản xuất và tiêu dùng hiệu quả từ đó giúp tăng trưởng kinh tế. Đặc biệt trong giai đoạn khủng hoảng dòng kiều hối chính là nguồn bổ sung ngoại tệ quan trọng, đồng thời tạo thu nhập cho người dân để kích thích kinh tế do đó công tác kiểm soát tham nhũng cần phải tiến hành mạnh mẽ hơn.

Hai là, với xu hướng hội tụ trong chất lượng kiểm soát tham nhũng, cũng như chênh lệch hiện tại giữa các quốc gia, các nước nhỏ và có tình trạng tham nhũng cao như Việt Nam cần phải thực thi các chính sách chống tham nhũng quyết liệt hơn để theo kịp các quốc gia trong khu vực tránh để tình trạng tham nhũng cản trở tăng trưởng trong dài hạn của quốc gia mình ■

Tài liệu tham khảo

- Abdih, Y., Chami, R., Dagher, J., & Montiel, P. (2012). Remittances and Institutions: Are Remittances a Curse? *World Development*, 40(4), 657-666. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2011.09.014>
- Acosta, P., Calderón, C., Fajnzylber, P., & Lopez, H. (2008). What is the Impact of International Remittances on Poverty and Inequality in Latin America? *World Development*, 36(1), 89-114. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2007.02.016>
- Acosta, P. A., Lartey, E. K. K., & Mandelman, F. S. (2009). Remittances and the Dutch disease. *Journal of International Economics*, 79(1), 102-116. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.jinteco.2009.06.007>
- Adams Jr, R. H., & Cuecuecha, A. (2010). Remittances, Household Expenditure and Investment in Guatemala. *World Development*, 38(11), 1626-1641. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2010.03.003>
- Adams Jr, R. H., & Cuecuecha, A. (2013). The Impact of Remittances on Investment and Poverty in Ghana. *World Development*, 50, 24-40. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2013.04.009>
- Adams Jr, R. H., & Page, J. (2005). Do international migration and remittances reduce poverty in developing countries? *World Development*, 33(10), 1645-1669. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2005.05.004>
- Aggarwal, R., Demirgüç-Kunt, A., & Pería, M. S. M. (2011). Do remittances promote financial development? *Journal of Development Economics*, 96(2), 255-264. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.jdeveco.2010.10.005>
- Ahmed, F. Z. (2010). Remittances foster government corruption. *Unpublished Working Paper*.
- Ahmed, F. Z. (2013). Remittances deteriorate governance. *Review of Economics and Statistics*, 95(4), 1166-1182.
- Anzoategui, D., Demirgüç-Kunt, A., & Martínez Pería, M. S. (2014). Remittances and Financial Inclusion: Evidence from El Salvador. *World Development*, 54, 338-349. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2013.10.006>
- Arellano, M. (2003). Panel data econometrics. *OUP Catalogue*.
- 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.
- Baltagi, B. H., Song, S. H., Jung, B. C., & Koh, W. (2007). Testing for serial correlation, spatial autocorrelation and random effects using panel data. *Journal of Econometrics*, 140(1), 5-51.
- Bayangos, V., & Jansen, K. (2011). Remittances and Competitiveness: The Case of the Philippines. *World Development*, 39(10), 1834-1846. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2011.04.019>
- Beine, M., Lodigiani, E., & Vermeulen, R. (2012). Remittances and financial openness. *Regional Science and Urban Economics*, 42(5), 844-857. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.regsciurbeco.2011.12.005>
- Berdiev, A. N., Kim, Y., & Chang, C.-P. (2013). Remittances and corruption. *Economics Letters*, 118(1), 182-185. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.econlet.2012.10.008>
- Bettin, G., & Zazzaro, A. (2012). Remittances and financial development: substitutes or complements in economic growth? *Bulletin of Economic Research*, 64(4), 509-536.
- Bourdet, Y., & Falck, H. (2006). Emigrants' remittances and Dutch disease in Cape Verde. *International Economic Journal*, 20(3), 267-284.
- Campos, N. F., & Nugent, J. B. (1999). Development performance and the institutions of governance: evidence from East Asia and Latin America. *World Development*, 27(3), 439-452.
- Catrinescu, N., Leon-Ledesma, M., Piracha, M., & Quillin, B. (2009). Remittances, Institutions, and Economic Growth. *World Development*, 37(1), 81-92. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2008.02.004>
- Chowdhury, M. B. (2011). Remittances flow and financial development in Bangladesh. *Economic Modelling*, 28(6), 2600-2608. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.econmod.2011.07.013>
- Combes, J.-L., & Ebeke, C. (2011). Remittances and household consumption instability in developing countries. *World Development*, 39(7), 1076-1089.
- Coulibaly, D. (2015). Remittances and financial development in Sub-Saharan African countries: A system approach. *Economic Modelling*, 45, 249-258. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.econmod.2014.12.005>
- Demirgüç-Kunt, A., Córdova, E. L., Pería, M. S. M., & Woodruff, C. (2011). Remittances and banking sector breadth and depth: Evidence from Mexico. *Journal of Development Economics*, 95(2), 229-241. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.jdevco.2010.04.002>
- Druck, P., Magud, N. E., & Mariscal, R. (2015). *Collateral Damage: Dollar Strength and Emerging Markets' Growth*. Retrieved from
- Fisman, R., & Gatti, R. (2000). Decentralization and corruption: Evidence across countries.
- Gupta, S., Pattillo, C. A., & Wagh, S. (2009). Effect of remittances on poverty and financial development in Sub-Saharan Africa. *World Development*, 37(1), 104-115.
- Gyimah-Brempong, K. (2002). Corruption, economic growth, and income inequality in Africa. *Economics of Governance*, 3(3), 183-209.
- Habib, M., & Zurawicki, L. (2002). Corruption and foreign direct investment. *Journal of International Business Studies*, 291-307.
- Imai, K. S., Gaiha, R., Ali, A., & Kaicker, N. (2014). Remittances, growth and poverty: New evidence from Asian countries. *Journal of Policy Modeling*, 36(3), 524-538. doi: <http://dx.doi.org/10.1016/j.jpolmod.2014.01.009>
- Kidd, J., & Richter, F.-J. (2003). *Fighting Corruption in Asia: Causes, Effects, and Remedies*: World Scientific.
- Knack, S. (2006). Measuring corruption in Eastern Europe and Central Asia: A critique of the cross-country indicators. *World Bank Policy Research Working Paper* (3968).
- Kwok, C. C., & Tadesse, S. (2006). The MNC as an agent of change for host-country institutions: FDI and corruption. *Journal of International Business Studies*, 37(6), 767-785.
- Lee, S.-H., & Oh, K. K. (2007). Corruption in Asia: Pervasiveness and arbitrariness. *Asia Pacific Journal of Management*, 24(1), 97-114.