

Đô thị hóa và nền kinh tế ngầm của các con Hồ mới châu Á

Nguyễn Lê Ngọc Hoàn¹, Nguyễn Văn Điệp^{1,*}, Lê Thanh Hoài²

¹ Trường Đại học Mở Thành phố Hồ Chí Minh, Việt Nam

² Trường Cao đẳng Kinh tế Đối ngoại, Việt Nam

TỪ KHÓA

Đô thị hóa,
Con Hồ mới châu Á,
Hồi quy Bayes,
Nền kinh tế ngầm.

TÓM TẮT

Bài viết này điều tra tác động của đô thị hóa đối với nền kinh tế ngầm tại một nhóm nước thuộc các con Hồ mới châu Á, bao gồm Indonesia, Malaysia, Philippines, Thái Lan và Việt Nam, trong giai đoạn 2002–2017. Kết quả phân tích bằng phương pháp hồi quy Bayes đã cung cấp bằng chứng mạnh mẽ ủng hộ mối quan hệ hình chữ U ngược giữa mức độ đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Từ góc độ chính sách, kết quả của chúng tôi cho thấy rằng các quốc gia chưa có quá trình đô thị hóa vượt ngưỡng cần nhanh chóng đẩy nhanh quá trình này để có quy mô nền kinh tế ngầm thấp hơn.

1. Giới thiệu

Nền kinh tế ngầm, hay còn được gọi là nền kinh tế bóng tối hay nền kinh tế phi chính thức, bao gồm tất cả các hoạt động kinh tế được giấu khỏi cơ quan chức năng vì lý do tiền tệ, quy định và thể chế (Elgin & cộng sự, 2022). Nền kinh tế ngầm là một vấn đề rất nghiêm trọng đối với nền kinh tế của xã hội ở một quốc gia. Các số liệu thống kê có liên quan đến những hoạt động trong nền kinh tế ngầm là không đầy đủ. Do đó, nó gây khó khăn cho việc hoạch định chính sách của các chính phủ. Mặt khác, sự gia tăng của nền kinh tế ngầm đặt ra thách thức cho tăng trưởng kinh tế. Vì vậy, nhiều học giả đã và đang tìm hiểu các yếu tố tác động đến quy mô của nền kinh tế kinh tế ngầm.

Các nghiên cứu gần đây tập trung xem xét vai trò của quá trình đô thị hóa đến nền kinh tế ngầm vì nó có vai trò quan trọng trong quá trình phát triển bền

vững (Ndoya & Dongmo, 2021). Đô thị hóa là một quá trình thường được coi là hệ quả thường xuyên của sự phát triển kinh tế (Elgin & Oyvat, 2013) hoặc đơn giản nó được định nghĩa là sự gia tăng tỷ lệ dân số sống ở khu vực thành thị (OECD, 2012). Theo đó, các thành phố và trung tâm đô thị có đóng góp lớn vào sự phát triển của một quốc gia. Nhìn chung, việc làm và những cơ hội kinh doanh thường tập trung xung quanh các đô thị lớn. Vì vậy, quá trình đô thị hóa sẽ làm cho các thành phố và môi trường đô thị trở nên toàn diện, an toàn, kiên cường và bền vững (Ndoya & Dongmo, 2021). Bên cạnh đó, các ngành công nghiệp mới ở thành thị tạo cơ hội việc làm mới, kích thích sự chuyển dịch lao động từ nông thôn ra thành thị. Tuy nhiên, nếu mức tăng trưởng việc làm trong khu vực chính thức có thể không theo kịp tốc độ tăng dân số của cư dân đô thị mới và đồng thời, quá trình di cư sang khu vực thành thị vẫn tiếp tục sẽ

* Tác giả liên hệ. Email: diep.nv@ou.edu.vn

<https://doi.org/10.61602/jdi.2024.77.xx>

Ngày nhận: 28/02/2024; Ngày chỉnh sửa: 09/4/2024; Duyệt đăng: 23/4/2024; Ngày online: 05/7/2024

ISSN (print): 1859-428X, ISSN (online): 2815-6234

kéo theo kết quả là nhiều cư dân mới phải tham gia vào các hoạt động đô thị không chính thức (Elgin & Oyvat, 2013). Tốc độ và quy mô đô thị hóa ở ASEAN khá ấn tượng. Ngày nay, hơn một nửa dân số ASEAN sống ở khu vực thành thị và ước tính sẽ có thêm 70 triệu người sống ở các thành phố ASEAN vào năm 2025, tương đương với dân số hiện tại của tất cả các thành phố thủ đô trong ASEAN. Đồng thời, quá trình đô thị hóa ở Đông Nam Á đang diễn ra xuyên suốt chuỗi đô thị-nông thôn, từ các cộng đồng nhỏ nhất và xa xôi nhất đến các siêu đô thị đang phát triển (Sharif, 2021). Mặc dù, đô thị hóa có vai trò quan trọng trong quá trình tăng trưởng kinh tế nhưng các nghiên cứu thực nghiệm xem xét tác động của nó lên nền kinh tế ngầm không có kết quả nhất quán. Mục đích của bài viết này là phân tích vai trò của đô thị hóa đối với nền kinh tế ngầm ở những nước thuộc nhóm các con hổ mới châu Á (Asian Tiger Cub). Các con hổ mới châu Á là tên được đặt cho năm nền kinh tế đang phát triển ở Đông Nam Á, bao gồm: Indonesia, Malaysia, Philippines, Thái Lan và Việt Nam. Cái tên này ngụ ý rằng các nền kinh tế này tuân theo mô hình tăng trưởng giống như mô hình của Bốn con hổ châu Á, đó là Hồng Kông, Singapore, Hàn Quốc và Đài Loan. Các nền kinh tế “Tiger Cub” đã bắt đầu thời kỳ bùng nổ của riêng mình kể từ cuối những năm 1980 nhờ vào lượng lớn đầu tư nước ngoài. Năm 1997 và 1998, các quốc gia này trải qua một cuộc khủng hoảng tài chính và đã phục hồi tương đối tốt kể từ cuối những năm 1990 và là những nước xuất khẩu hàng hóa lớn như công nghệ và điện tử. Sự xuất hiện của các nền kinh tế Tiger Cub có ảnh hưởng đến việc cải cách mô hình đô thị trong những thập kỷ tới (Chen & cộng sự, 2020). Tuy nhiên, theo sự hiểu biết tốt nhất của nhóm tác giả thì vẫn chưa có nghiên cứu nào xem xét ảnh hưởng của đô thị hóa đối với nền kinh tế ngầm của nền kinh tế “Tiger Cub”. Để lấp đầy khoảng trống nghiên cứu này, nhóm tác giả sử dụng kỹ thuật hồi quy Bayes để xử lý bộ dữ liệu của 5 con hổ mới châu Á trong giai đoạn 2002–2017 nhằm tìm hiểu mối quan hệ này. Kết quả phân tích của bài viết cung cấp bằng chứng thực nghiệm cho thấy có mối quan hệ chữ U ngược giữa nền kinh tế ngầm và mức độ đô thị hóa của các nước này. Ngoài ra, nghiên cứu này còn cho thấy tăng trưởng kinh tế và mức độ ổn định chính trị càng cao sẽ làm giảm quy mô nền kinh tế ngầm, trong khi đó hoạt động thương mại quốc tế làm gia tăng các hoạt động trong nền kinh tế ngầm.

Phần còn lại của bài viết này được tổ chức như sau. Phần 2 lược khảo các nghiên cứu thực nghiệm

liên quan. Phần 3 sẽ mô tả mô hình, dữ liệu và kỹ thuật ước lượng. Phần 4 thảo luận về kết quả và phần 5 kết thúc bằng kết luận.

2. Cơ sở lý thuyết

2.1. Các lý thuyết và các nghiên cứu liên quan

2.1.1. Lý thuyết kinh tế học thể chế mới

Lý thuyết Kinh tế học thể chế mới nhấn mạnh tầm quan trọng của các thể chế và các quy tắc của chúng đối với hoạt động của nền kinh tế. Các học giả của lý thuyết này đặc biệt chú ý đến cách các thể chế tác động đến “những người hưởng lợi (free-riders)” từ việc tham gia vào nền kinh tế ngầm và không nộp thuế (Williamson, 2000). Nó cũng có thể giúp hiểu được những thất bại trong các thể chế chính thức và phi chính thức có thể khiến nền kinh tế ngầm xuất hiện và tồn tại. Ví dụ, lý thuyết cho rằng các quy định phức tạp và chi phí tuân thủ cao có thể khuyến khích công dân và doanh nghiệp trốn thuế và do đó, họ chọn tham gia vào các giao dịch không chính thức để giảm thiểu chi phí, tránh các quy định cao hoặc ngăn hệ thống tư pháp không thể thực thi hợp đồng, điều này cũng có thể tạo ra động cơ cho nền kinh tế ngầm. Một số yếu tố này như sau: chi phí tuân thủ quy định cao, chẳng hạn như tính phức tạp hoặc mức thuế cao, có thể gây khó khăn cho việc thành lập doanh nghiệp hợp pháp và do đó khuyến khích việc doanh nghiệp tham gia trong nền kinh tế ngầm, nơi có các quy định, luật lệ và thuế ít đòi hỏi hơn. Mặt khác, các biện pháp khuyến khích và trừng phạt cũng đóng một vai trò trong nền kinh tế ngầm vì nếu mức phạt đối với hành vi không tuân thủ thấp, các cá nhân và doanh nghiệp có thể coi trốn thuế là một lựa chọn có lợi hoặc có lợi hơn cho họ. Một ví dụ khác là tính hợp pháp, nếu người dân tin rằng các quy định và thuế là không công bằng hoặc các cơ quan chính phủ tham nhũng thì họ sẽ có ít động lực hơn để nộp thuế.

Ngoài ra, sự thiếu tin tưởng vào các tổ chức công ảnh hưởng đến nhu cầu về tiền khi các cá nhân, còn được gọi là “những người hưởng lợi”, thường ít sẵn sàng sử dụng các dịch vụ ngân hàng chính thức. Vì vậy, họ thích giữ tiền mặt như một hình thức thanh toán các giao dịch không chính thức. Lý thuyết Kinh tế thể chế mới cũng tính đến tầm quan trọng của các quy tắc ứng xử trong xã hội. Những xã hội chấp nhận việc trốn thuế và các hoạt động không chính thức sẽ khuyến khích nhu cầu tiền mặt

lớn hơn cho các giao dịch này.

2.1.2. *Lược khảo các nghiên cứu thực nghiệm*

Các nghiên cứu trước đây cho thấy ảnh hưởng của đô thị hóa lên nền kinh tế ngầm là không nhất quán.

Thứ nhất là các nghiên cứu chưa cho thấy có bằng chứng về tác động của đô thị hóa lên kinh tế ngầm. Torgler và Schneider (2007) có thể được xem là những người đầu tiên nghiên cứu sơ lược mối quan hệ giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Mặc dù bài viết này tập trung phân tích ảnh hưởng của quản trị hoặc chất lượng thể chế và tinh thần thuế đến nền kinh tế ngầm nhưng hai tác giả cũng xem xét vai trò của đô thị hóa đến nền kinh tế ngầm. Bằng việc phân tích dữ liệu Bảng không cân bằng với thời gian là 1990, 1995 và 2005 của các quốc gia trên thế giới, họ tìm thấy hệ số hồi quy của biến đô thị hóa mang dấu dương nhưng chưa xác nhận bằng chứng của mối quan hệ cùng chiều giữa đô thị hóa và kinh tế ngầm vì hệ số hồi quy không có ý nghĩa thống kê. Xu và cộng sự (2018) phân tích ảnh hưởng của rủi ro quốc gia lên quy mô nền kinh tế ngầm và bổ sung thêm biến kiểm soát là đô thị hóa để xác nhận bằng chứng về mối quan hệ chữ U ngược giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Tuy nhiên, kết quả bằng hồi quy cho dữ liệu Bảng không có bằng chứng nào về mối quan hệ chữ U ngược giữa đô thị hóa và quy mô của nền kinh tế ngầm.

Quan điểm thứ hai cho thấy rằng đô thị hóa có tác động cùng chiều đến nền kinh tế ngầm. Chẳng hạn, Ghosh và Paul (2008) tập trung xem xét ảnh hưởng của thương mại quốc tế lên sự tăng trưởng của nền kinh tế ngầm của 18 quốc gia Trung, Đông Âu và Liên Xô cũ trong giai đoạn 1990-1995. Hai tác giả này thấy rằng thương mại quốc gia có tác động thuận chiều lên nền kinh tế ngầm. Bên cạnh đó, với vai trò mà một trong những biến kiểm soát, hai tác giả này cũng tiết lộ rằng mức độ đô thị hóa càng cao sẽ thúc đẩy sự gia tăng của nền kinh tế ngầm.

Trái ngược với dòng quan điểm trên, Acosta-González và cộng sự (2014) khi xem xét các yếu tố tác động đến nền kinh tế ngầm của 30 nước OECD và 8 nước Đông Âu. Bằng kỹ thuật OLS trên bộ dữ liệu của 38 nước trong giai đoạn 1991–2007 đã cho thấy đô thị hóa làm giảm quy mô của nền kinh tế ngầm.

Cuối cùng, Elgin và Oyvatt (2013) khi phân tích ảnh hưởng của đô thị hóa lên nền kinh tế ngầm của 152 nền kinh tế trong giai đoạn 1999-2007 đã cho thấy có mối quan hệ chữ U ngược giữa nền kinh tế

ngầm và mức độ đô thị hóa. Nghĩa là, tỷ trọng của khu vực kinh tế ngầm tăng lên trong giai đoạn đầu của quá trình đô thị hóa; tuy nhiên, nó có xu hướng giảm ở các giai đoạn sau. Thống nhất với kết luận này, Ndoya và Dongmo (2021) sử dụng phương pháp mô men tổng quát (GMM) và hồi quy chuyển tiếp tron cho dữ liệu Bảng (PSTR) trên dữ liệu Bảng không cân bằng của 45 quốc gia châu Phi trong giai đoạn 2000-2015 nhằm xem xét vai trò của quản trị trong mối quan hệ giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Kết quả của họ cho thấy có mối quan hệ hình chữ U ngược giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Ở giai đoạn trước, đô thị hóa làm tăng nền kinh tế ngầm ở Châu Phi, và ở giai đoạn sau, ảnh hưởng của đô thị hóa lên nền kinh tế ngầm giảm đi cùng với sự tương tác của chất lượng quản trị.

Tóm lại, các kết quả từ các thực nghiệm trước cho thấy mối quan hệ giữa đô thị hóa về quy mô nền kinh tế ngầm là hỗn hợp. Do đó, bài viết này xem xét ảnh hưởng tuyến tính và phi tuyến của đô thị hóa lên quy mô nền kinh tế ngầm bằng kỹ thuật hồi quy Bayes.

3. Mô hình và kỹ thuật ước lượng

3.1. *Mô hình*

Mô hình kinh tế lượng của mối quan hệ phi tuyến giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm được đưa ra như sau:

$$SSE = \beta_0 + \beta_1 URBA + \varepsilon \quad (1)$$

$$SSE = \beta_0 + \beta_1 URBA + \beta_2 URBA^2 + \varepsilon \quad (2)$$

Trong đó SSE được dùng để đại diện cho nền kinh tế ngầm của các quốc gia; URBA và URBA² lần lượt tỷ lệ đô thị hóa và bình phương của tỷ lệ đô thị hóa của các quốc gia; ε là sai số ngẫu nhiên trong mô hình. Chúng tôi kỳ vọng β_1 là dương và β_2 là âm và những dấu hiệu này thể hiện mối quan hệ parabol giữa mức độ đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Để đo mức độ đô thị hóa khi quy mô nền kinh tế ngầm bắt đầu giảm, chúng tôi ước tính ngưỡng hoặc bước ngoặt của mối quan hệ parabol, được thể hiện như sau:

$$URBA^* = -\frac{\beta_1}{2\beta_2} \quad (3)$$

Tiếp theo, chúng tôi sẽ bổ sung các biến kiểm soát mà có tác động đến nền kinh tế ngầm vào phương trình (1). Vì vậy, phương trình (3) có dạng như sau:

$$SSE = \beta_0 + \beta_1 URBA + \beta_2 URBA^2 + \sum_{k=3}^n \beta_k X_k + \varepsilon \quad (4)$$

Với X là một vector của những yếu tố kiểm soát mà có tác động lên quy mô nền kinh tế ngầm được đề xuất bởi các tài liệu thực nghiệm công bố trước đây. Những biến kiểm soát này bao gồm tăng trưởng kinh tế (GDPG), thương mại quốc tế (OPEN), và mức độ ổn định chính trị (PSAV).

3.2. Nguồn dữ liệu

Dữ liệu trong bài viết này là dữ liệu thứ cấp hàng năm được thu thập cho 5 con Hồ mới châu Á trong giai đoạn 2002–2017. Việc lựa chọn giai đoạn nghiên cứu này xuất phát từ sự sẵn có của dữ liệu về các biến số của mô hình. Do đó, mẫu nghiên cứu của bài biết bao gồm 80 quan sát quan sát theo hàng năm của năm quốc gia.

Về nguồn thu thập dữ liệu: Biến phụ thuộc của bài viết là nền kinh tế ngầm (SSE) được chúng tôi lấy từ nghiên cứu của Medina và Schneider (2019). Trong công trình của hai tác giả này, họ đã áp dụng mô hình đa chỉ số đa nguyên nhân (MIMIC) để ước tính quy mô của nền kinh tế ngầm tính theo phần trăm GDP. Biến giải thích chính của bài viết là mức độ đô thị hóa (URBA), thể hiện bằng phần trăm dân số đô thị trên tổng dân số, được lấy từ Bộ các chỉ số Phát triển Thế giới (WDI) của Ngân hàng Thế giới. Dựa vào các tài liệu thực nghiệm khi phân tích các yếu tố có ảnh hưởng đến nền kinh tế ngầm (Elgin & Oyvat, 2013; Ghosh & Paul, 2008; Ndoya & Dongmo, 2021; Siddik & cộng sự, 2022; Torgler & Schneider, 2007), chúng tôi sử dụng các yếu tố khác làm biến kiểm soát: (i) Tăng trưởng kinh tế (GDPG); (ii) Thương mại quốc tế (OPEN) và (iii) Ổn định chính trị (PSAV). Các biến GDPG và OPEN được lấy từ WDI. Biến PSAV được lấy từ Bộ Chỉ số Quản trị Toàn cầu (WGI) của Ngân hàng Thế giới. Bảng 1 mô tả các biến số của bài viết.

3.3. Kỹ thuật ước lượng

Chúng tôi sử dụng phân tích thống kê Bayes để xem xét ảnh hưởng của đô thị hóa lên nền kinh tế ngầm của các con Hồ mới châu Á. Quy tắc Bayes, cung cấp các ước tính dựa trên cả thông tin và bằng chứng trước đó, được sử dụng trong phân tích Bayes. Biểu thức toán học của Định lý Bayes, làm cơ sở cho các suy luận thống kê Bayes, như sau:

$$p(\theta|X) = \frac{p(X|\theta)p(\theta)}{P(X)} \quad (5)$$

Trong đó: $p(\theta|X)$ là phân bố của các tham số cho dữ liệu (còn gọi là phân phối hậu nghiệm); $p(X|\theta)$ là khả năng xảy ra của dữ liệu; $p(\theta)$ là thông tin hoặc niềm tin trước đó (còn gọi là phân phối tiên nghiệm) và $P(X)$ là hằng số chuẩn hóa và có thể bị loại ra khỏi phương trình bởi vì nó không phụ thuộc vào tham số θ (Van De Schoot & cộng sự, 2021). Vì vậy, phân phối hậu nghiệm sẽ tỷ lệ thuận với hàm khả năng nhân với phân phối tiên nghiệm như phương trình 6 sau đây:

$$p(\theta|X) \propto p(X|\theta)p(\theta) \quad (6)$$

Để thực hiện hồi quy Bayes thì đối với tiên nghiệm, chúng tôi sử dụng phân phối chuẩn với phương sai đáng kể với giả định giá trị tiên nghiệm không mang tính thông tin (non-informative prior) cho từng tham số chưa biết trong mô hình. Với giá trị trung bình tiên nghiệm là 1 và phương sai là 100. Đối với hàm khả năng, chúng tôi giả sử phân phối chuẩn với những tham số đến từ mô hình 1 và 2. Cuối cùng, chúng tôi ứng dụng kỹ thuật mô phỏng Monte Carlo cho những chuỗi Markov (MCMC) và thuật toán lấy mẫu Gibbs để đạt được phân bố đơn biến tương ứng của những

Bảng 1. Định nghĩa các biến và nguồn thu thập dữ liệu

Biến số	Ký hiệu	Đo lường	Nguồn
Biến phụ thuộc			
Nền kinh tế ngầm	SSE	Quy mô nền kinh tế ngầm (% của GDP) đo lường bằng kỹ thuật MIMIC	Medina và Schneider (2019)
Biến độc lập			
Đô thị hóa	URBA	Tỷ lệ dân số đô thị trên tổng dân số (%)	WDI
Biến kiểm soát			
Tăng trưởng kinh tế	GDPG	Tăng trưởng của GDP bình quân đầu người (% hàng năm)	WDI
Thương mại quốc tế	OPEN	Tổng giá trị xuất nhập khẩu trên GDP (% của GDP)	WDI
Ổn định chính trị	PSAV	Điểm số từ -2,5 đến 2,5 (điểm số càng cao thì chính trị càng ổn định)	WGI

hệ số của phân phối hậu nghiệm.

4. Những phát hiện và thảo luận

4.1. Thống kê mô tả và phân tích tương quan

Bảng 2 trình bày số liệu thống kê mô tả của các biến liên quan và Bảng 3 trình bày thống kê mô tả hai biến số quan tâm trong bài viết này theo từng quốc gia trong nhóm con Hồ mới. Cụ thể, Bảng 2 cho thấy số liệu thống kê mô tả của biến phụ thuộc (SSE), tức là quy mô nền kinh tế ngầm (% GDP) và biến độc lập chính (URBA), tức là mức độ đô thị hóa (% dân số thành thị trên tổng dân số). Nhìn chung, quy mô SSE trung bình của nhóm năm con Hồ mới là gần 31% (chiếm khoảng gần 1/3 GDP) và khoảng 48% dân số của năm nước này sống ở thành thị. Bên cạnh đó, Bảng 2 cũng cung cấp tóm tắt các giá trị trung bình, độ lệch chuẩn, giá trị lớn nhất và nhỏ nhất của các biến kiểm soát.

Bảng 3 cho thấy rằng Thái Lan có quy mô nền kinh tế ngầm trung bình cao nhất tính theo phần trăm GDP với giá trị là 47,07 % GDP. Trong khi đó, Việt Nam có quy mô nền kinh tế ngầm trung bình thấp nhất với giá trị là 16,15 %. Đối với URBA, Indonesia có giá trị URBA trung bình cao nhất, tức là 49,32 %, điều này có nghĩa gần một nửa dân số của Indonesia tập trung ở các khu vực thành thị. Với giá trị trung bình là 30,20 % thì Việt Nam là quốc gia có mức độ đô thị hóa thấp nhất trong nhóm năm con Hồ mới châu Á. Nói cách khác chỉ có khoảng 30,20 % dân số của Việt Nam sống tại các khu thành thị.

Bảng 4 cung cấp những thông tin về mối tương

quan giữa biến đô thị hóa (URBA) và biến nền kinh tế ngầm (SSE). Bảng này cho thấy hệ số tương quan giữa chúng là dương nhưng yếu ($r = 0,108$). Bên cạnh đó, kết quả tại Bảng này cũng cho thấy tăng trưởng kinh tế (GDPG), thương mại quốc tế (OPEN) và mức độ ổn định chính trị (PSAV) có mối tương quan nghịch chiều với nền kinh tế ngầm (SSE). Cụ thể, giữa GDPG và PSAV với SSE có mối tương quan trung bình, trong khi đó mối tương quan giữa OPEN và SSE là tương quan yếu.

4.2. Kết quả hồi quy

Trước khi thực hiện suy luận thống kê Bayes, một số chẩn đoán MCMC cần được thực hiện, bao gồm chỉ số hiệu quả lấy mẫu và thống kê R_c . Chỉ số hiệu quả lấy mẫu càng cao và lớn hơn 0,1 thì khả năng hội tụ của MCMC càng tốt. Tuy nhiên, chỉ số hiệu quả lấy mẫu không nên quá gần 1, vì nếu quá gần 1 thì các giá trị mô phỏng sẽ mất đi khả năng thích ứng với dữ liệu thực nghiệm. Ngoài ra, chúng tôi sử dụng thêm thống kê R_c để kiểm tra sự hội tụ của các chuỗi MCMC với điều kiện là giá trị của thống kê R_c phải nhỏ hơn 1,2.

Kết quả tại Bảng 5 cho thấy chỉ số hiệu quả lấy mẫu bé nhất trong các mô hình hiệu chỉnh đều vượt qua giá trị tiêu chuẩn 0,1 và giá trị thống kê R_c lớn nhất của các mô hình đều nhỏ hơn 1,2 nên cho thấy sự hội tụ cao của chuỗi MCMC. Trên cơ sở chẩn đoán MCMC thì kết luận rằng các kết quả ước lượng từ mô hình hồi quy Bayes có thể được sử dụng để thực hiện các suy diễn thống kê. Chi tiết mô phỏng hậu nghiệm Bayes và các thông số cho việc chẩn đoán MCMC

Bảng 2. Thống kê mô tả

Biến số	Trung bình	Độ lệch chuẩn	Nhỏ nhất	Lớn nhất
SSE	30,75	11,25	12,50	52,80
URBA	47,56	13,51	25,51	75,45
GDPG	4,02	1,74	-3,29	6,99
OPEN	115,64	48,44	37,42	210,37
PSAV	-0,57	0,76	-2,09	0,56

Bảng 3. Thống kê mô tả theo quốc gia cho hai biến số quan tâm

Quốc gia	SSE	URBA
Indonesia	22,87	49,32
Malaysia	29,49	70,12
Philippines	38,18	45,83
Thailand	47,07	42,32
Vietnam	16,15	30,20

Bảng 4. Phân tích ma trận tương quan

	SSE	URBA	GDPG	OPEN	PSAV
SSE	1				
URBA	0,108	1			
GDPG	-0,306	-0,332	1		
OPEN	-0,058	0,104	0,016	1	
PSAV	-0,491	0,125	0,250	0,657	1

Bảng 5. Kết quả hồi quy Bayes

Biến phụ thuộc: SSE					
Biến số	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
URBA	0,5882 (1,0000)*	1,2637 (1,0000)*	1,4648 (1,0000)*	1,4203 (1,0000)*	1,2741 (1,0000)*
URBA ^{squared}	— —	-0,0119 (1,0000)**	-0,0141 (1,0000)**	-0,0139 (1,0000)**	-0,0123 (1,0000)**
GDPG	— —	— —	-1,0780 (0,9787)**	-1,1686 (0,9830)**	-1,0537 (0,9750)**
OPEN	— —	— —	— —	0,0176 (0,7825)*	0,0315 (0,9133)*
PSAV	— —	— —	— —	— —	-1,7206 (0,9658)*
Hằng số	0,8745 (0,8134)*	-0,0936 (0,5340)**	-0,0296 0,5129**	-0,0637 0,5252**	-0,0548 0,5215**
Phương sai	178,56	112,59	105,43	105,70	98,56
Ngưỡng	—	52,98	51,81	51,03	51,65
Chẩn đoán MCMC					
Thống kê Rc lớn nhất	1,0002	1,0000	1,0001	1,0001	1,0001
Chỉ số hiệu quả lấy mẫu bé nhất	0,9377	0,9496	0,9206	0,8968	0,7883

Ghi chú: Trong ngoặc đơn là xác suất hậu nghiệm của từng tham số trung bình; *, ** lần lượt là xác suất hậu nghiệm dương, âm của các tham số trung bình. Giá trị “ngưỡng” được tính theo công thức (3).

được trình bày tại Bảng 5.

Bảng 5 cho thấy các kết quả hồi quy về mối quan hệ giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm. Cột đầu tiên báo cáo kết quả của mô hình đơn biến không có bất kỳ biến kiểm soát nào. Cụ thể tham số trung bình của biến URBA = 0,5882 và xác suất hậu nghiệm là tham số này có tác động cùng chiều lên quy mô nền kinh tế ngầm là 100%. Kết quả này hàm ý rằng các quốc gia thuộc nhóm các con hổ mới châu Á có mức độ đô thị hóa càng cao sẽ có quy mô nền kinh tế ngầm càng cao và kết quả của chúng tôi phù hợp với phát hiện chính của Ghosh và Paul (2008). Cột thứ hai, URBA được bổ sung thêm dưới dạng bình phương (URBA^{squared}), các hệ số của hai biến này đều mang dấu kỳ vọng ($\beta_1 > 0$ và $\beta_2 < 0$). Cụ thể, hệ số trung bình của biến URBA là $\beta_1 = 1,2637$ và của biến URBA^{squared} là $\beta_2 = -0,0119$

và đều có xác suất hậu nghiệm là 100%. Kết quả này cho thấy có mối quan hệ hình chữ U ngược giữa đô thị hóa và nền kinh tế ngầm và tương đồng với những kết luận từ các công trình trước (Elgin & Oyvat, 2013; Ndoya & Dongmo, 2021). Sharif (2021) cho rằng đô thị hóa là động lực thúc đẩy tăng trưởng kinh tế ở các thành phố Đông Nam Á. Phần lớn sự tăng trưởng này diễn ra không chỉ ở các thành phố lớn như Bangkok, Jakarta và Manila mà còn ở các thành phố nhỏ hơn và trung bình với dân số từ 500.000 đến 5 triệu người. Các thành phố của các nền kinh tế thuộc con hổ mới châu Á nói riêng và các nước ASEAN nói chung là động lực tăng trưởng quốc gia và khu vực, tiếp tục thu hút các hộ gia đình và cá nhân di chuyển đến đồng thời mang lại nhiều cơ hội về kinh tế, xã hội và văn hóa. Các thành phố ASEAN, như Manila, Bangkok

và Jakarta, cũng là một số thành phố đông dân nhất thế giới với số lượng dự kiến vẫn sẽ tăng do quá trình công nghiệp hóa nhanh chóng và làn sóng người dân địa phương di cư từ nông thôn. Theo Chương trình Môi trường Liên Hợp Quốc, đến năm 2050, cứ 10 người trong khu vực sẽ có 6 người là cư dân thành thị. Sự thay đổi nhân khẩu học đáng kể này sẽ xác định lại diện mạo của các thành phố trong tương lai (Sok & Ronan, 2021). Tuy nhiên, quá trình đô thị hóa nhanh chóng, cùng với lượng lớn người di cư vào các thành phố và các chính quyền đô thị thiếu năng lực quản lý phù hợp, thì sẽ có xu hướng hình thành tình trạng nghèo đói và bất bình đẳng đáng kể ở các đô thị. Cụ thể, đô thị hóa nhanh chóng cũng gây áp lực lên chính quyền địa phương trong việc cung cấp đầy đủ cơ sở hạ tầng, nhà ở và dịch vụ công cộng. Khi khu vực đô thị phát triển hơn nữa, việc tăng giá bất động sản ở các nước ASEAN trong đó có các con Hồ mới là điều không thể tránh khỏi và sẽ khiến những cư dân thành phố nghèo hơn phải di dời và hình thành các khu định cư không chính thức (khu ổ chuột) ở khu vực thành thị. Ngược lại, nếu được quản lý tốt thì quá trình đô thị hóa sẽ giúp phát triển doanh nghiệp hiện có và hình thành các doanh nghiệp mới. Điều này ngụ ý rằng quy mô của các doanh nghiệp hiện đại đã mở rộng và gia tăng được nhiều việc làm hơn do quá trình đô thị hóa. Những lao động tự làm (own-account workers) trước đây và lao động gia đình sẽ chuyển sang khu vực chính thức, do đó sẽ giúp làm giảm tỷ lệ việc làm dễ bị tổn thương. Những kết quả này hàm ý rằng quá trình đô thị hóa sẽ làm giảm quy mô của nền kinh tế ngầm.

Trong cột 3, 4 và 5, chúng tôi đưa vào mô hình các biến kiểm soát bao gồm tăng trưởng kinh tế (GDPG), độ mở thương mại (OPEN) và sự ổn định chính trị (PSVA). Kết quả cho thấy tăng trưởng kinh tế có tác động tiêu cực đến quy mô nền kinh tế ngầm, điều này nhất quán với các nghiên cứu trước đó (Ndoya & Dongmo, 2021; Siddik & cộng sự, 2022; Xu & cộng sự, 2018). Thương mại quốc tế được tìm thấy có mối

quan hệ cùng chiều với quy mô nền kinh tế ngầm và tương đồng với công trình (Ghosh & Paul, 2008). Trong khi đó, các quốc gia thuộc nhóm con Hồ mới châu Á có sự ổn định chính trị càng cao sẽ có nền kinh tế ngầm càng nhỏ và phù hợp với công trình trước đây (Ndoya & Dongmo, 2021; Siddik & cộng sự, 2022; Torgler & Schneider, 2007). Đối với các hệ số của số hạng tuyến tính và bình phương của biến đô thị hóa vẫn giữ nguyên dấu và xác suất hậu nghiệm vẫn ở mức cực kỳ cao, tức là 100%. Bảng 5 cũng trình bày kết quả ước tính mức ngưỡng và chúng ta có thể thấy rằng giá trị của nó nằm trong khoảng từ 51,03% đến 52,98%. Những giá trị ngưỡng này hàm ý rằng ở giai đoạn đầu của quá trình phát triển kinh tế, mức độ đô thị hóa của các quốc gia tăng sẽ dẫn đến các hoạt động trong nền kinh tế ngầm ngày càng gia tăng. Tuy nhiên, khi quá trình đô thị hóa vượt qua ngưỡng này (chẳng hạn như vượt qua ngưỡng 53%) thì quy mô nền kinh tế ngầm sẽ giảm xuống.

Nếu so sánh giá trị trung bình của mức độ đô thị hóa với ngưỡng, có thể thấy đa phần các nền kinh tế của các con Hồ mới châu Á đều ở dưới ngưỡng. Cụ thể, mức độ đô thị hóa của Indonesia, Philippines, Thái Lan và Việt Nam đều ở dưới ngưỡng nên sự gia tăng mức độ đô thị hóa sẽ làm tăng quy mô của nền kinh tế ngầm tại bốn quốc gia này. Ngược lại, Malaysia có mức độ đô thị hóa trên ngưỡng nên sự mở rộng của đô thị hóa sẽ giúp làm giảm quy mô của các hoạt động trong nền kinh tế ngầm của quốc gia này.

5. Kết luận

Mục tiêu của nghiên cứu này là đo lường tác động của đô thị hóa lên quy mô của nền kinh tế ngầm của các con Hồ mới châu Á trong giai đoạn 2002-2017. Để đạt được mục tiêu như vậy, chúng tôi ước tính các mô hình nghiên cứu bằng kỹ thuật hồi quy Bayes và kết quả thu được cho thấy mức độ đô thị hóa có ảnh hưởng phi tuyến theo hình chữ U ngược đến nền kinh tế ngầm ở các nước này.

Bảng 5. Mức độ đô thị hóa của các con Hồ mới châu Á so với ngưỡng

Quốc gia	URBA	URBA so với ngưỡng	URBA → SSE
Indonesia	49,32	Dưới	Thuận chiều
Malaysia	70,12	Trên	Nghịch chiều
Philippines	45,83	Dưới	Thuận chiều
Thailand	42,32	Dưới	Thuận chiều
Vietnam	30,20	Dưới	Thuận chiều

Nền kinh tế ngầm là một hiện tượng phổ biến ở các nước đang phát triển, đặt ra những vấn đề nghiêm trọng về kinh tế, xã hội và chính trị. Tuy nhiên, các chính phủ không thể nào triệt tiêu hoàn toàn những hoạt động trong nền kinh tế ngầm mà cần các chính sách nên hướng tới việc khuyến khích các cá nhân và doanh nghiệp tham gia vào khu vực của nền kinh tế chính thức. Dựa trên những kết quả của nghiên cứu này, chúng tôi tin rằng chính phủ các nước thuộc nhóm các con Hổ mới châu Á nên theo đuổi các chính sách nhằm thúc đẩy quá trình đô thị hóa. Vì khi mức độ đô thị hóa vượt qua điểm ngưỡng thì quá trình đô thị hóa sẽ làm giảm các hoạt động bất hợp pháp mà nó xảy ra trong nền kinh tế ngầm. Tuy nhiên, đô thị hóa đang khiến những thách thức phát triển trở nên phức tạp hơn, không chỉ về nhu cầu nhà ở tốt hơn và cung cấp dịch vụ cơ bản mà còn về các vấn đề môi trường, sức khỏe cộng đồng và biến đổi khí hậu. Do đó, quản trị đô thị tốt là yếu tố quyết định quan trọng cho sự phát triển đô thị bền vững ở các quốc gia này.

Bên cạnh đó, chính phủ các con Hổ mới châu Á cần có các chính sách thúc đẩy tăng trưởng kinh tế, xem xét cân trọng các mặt hàng xuất nhập khẩu và cần gia tăng sự ổn định chính trị của quốc gia, đặc biệt là nạn tham nhũng đang tràn lan ở khu vực thành thị. Những điều này có thể khuyến khích các cá nhân và doanh nghiệp rời khỏi nền kinh tế ngầm và tham gia vào các hoạt động chính thức.

Có những hạn chế nhất định của nghiên cứu này cần được khắc phục bằng các nghiên cứu trong tương lai. Thứ nhất, nghiên cứu này chỉ hoàn thành mục tiêu trong bối cảnh các nước thuộc nhóm các con Hổ mới châu Á. Các nghiên cứu trong tương lai được khuyến nghị thực hiện phân tích tương tự bằng cách xem xét các nhóm quốc gia khác nhau. Thứ hai, nghiên cứu này không xem xét ảnh hưởng của đô thị hóa lên kinh tế ngầm trong ngắn hạn và dài hạn, do đó các nghiên cứu tiếp theo có thể xem xét tác động của đô thị hóa lên quy mô nền kinh tế ngầm trong ngắn và hạn. Cuối cùng, nghiên cứu này chỉ tập trung xem xét yếu tố đô thị hóa lên kinh tế ngầm, các nghiên cứu trong tương lai có thể xem xét sự tác động của các nhân tố khác lên quy mô của nền kinh tế ngầm hoặc xem xét ảnh hưởng của đô thị hóa lên sự phát triển bền vững của các quốc gia.

TÀI LIỆU THAM KHẢO

Acosta-González, E., Fernández-Rodríguez, F., & Sosvilla-Rivero, S. (2014). An empirical examination of the determinants of the shadow economy. *Applied Economics*

- Letters*, 21(5), 304-307. DOI: <https://doi.org/10.1080/13504851.2013.856993>
- Chen, T. L., Chiu, H. W., & Lin, Y. F. (2020). How do East and Southeast Asian Cities Differ from Western Cities? A Systematic Review of the Urban Form Characteristics. *Sustainability*, 12(6), 2423. DOI: <https://doi.org/10.3390/su12062423>
- Elgin, C., Kose, M. A., Ohnsorge, F., & Yu, S. (2022). *Understanding informality*. Centre for Economic Policy Research. London, England.
- Elgin, C., & Oyvat, C. (2013). Lurking in the cities: Urbanization and the informal economy. *Structural Change and Economic Dynamics*, 27, 36-47. DOI: <https://doi.org/10.1016/j.strueco.2013.06.003>
- Ghosh, A., & Paul, S. (2008). Opening the Pandora's box? Trade openness and informal sector growth. *Applied Economics*, 40(15), 1995-2007. doi:10.1080/00036840600915273
- Medina, L., & Schneider, F. (2019). *Shedding Light on the Shadow Economy: A Global Database and the Interaction with the Official One*. Center for Economic Studies and ifo Institute (CESifo). Munich, Germany.
- Ndoya, H., & Dongmo, A. D. (2021). Urbanization, governance and informal economy: An African Tale. *Economics Bulletin*, 41(3), 1525-1540.
- OECD. (2012). *Redefining "Urban": A New Way to Measure Metropolitan Areas*, OECD Publishing. Paris: OECD Publishing.
- Sharif, M. M. (2021). Capturing the Urban Opportunity in Southeast Asia. *The ASEAN*, 14, 11-13. <https://theaseanmagazine.asean.org/article/capturing-the-urban-opportunity-in-southeast-asia/>
- Siddik, M. N. A., Kabiraj, S., Hosen, M. E., & Miah, M. F. (2022). Impacts of Political Stability on Shadow Economy: Evidence from Bay of Bengal Initiative for Multi-sectoral Technical and Economic Cooperation Countries. *Vision*, 26(2), 221-231. DOI: <https://doi.org/10.1177/0972262920988387>
- Sok, V., & Ronan, D. J. (2021). Shaping Smarter ASEAN Cities: The Path Towards Environmentally Sustainable Cities. *The ASEAN*, 11, 17-19.
- Torgler, B., & Schneider, F. (2007). Shadow economy, tax morale, governance and institutional quality: a panel analysis. *IZA Discussion Paper*, 2563, 1-56.
- Van De Schoot, R., Depaoli, S., King, R., Kramer, B., Märtens, K., Tadesse, M. G., . . . Yau, C. (2021). Bayesian statistics and modelling. *Nature Reviews Methods Primers*, 1(1), 1-26. DOI: <https://doi.org/10.1038/s43586-020-00001-2>
- Williamson, O. E. (2000). The New Institutional Economics: Taking Stock, Looking Ahead. *Journal of Economic Literature*, 38(3), 595-613.
- Xu, T., Lv, Z., & Xie, L. (2018). Does Country Risk Promote the Informal Economy? A Cross-National Panel Data Estimation. *Global Economic Review*, 47(3), 289-310. DOI: <https://doi.org/10.1080/1226508X.2018.1450641>

Urbanization and the Shadow Economy of Asian Tiger Cub Economies

Nguyen Le Ngoc Hoan ¹, Nguyễn Văn Diệp ¹, Lê Thanh Hoài ²

¹ Ho Chi Minh City Open University, Vietnam

² College of Foreign Economic Relations, Vietnam

Abstract

This paper investigates the impact of urbanization on the shadow economy in a group of Asian Tiger Cub countries such as Indonesia, Malaysia, the Philippines, Thailand, and Vietnam over the period 2002–2017. Using Bayesian regression, our results provide strong evidence supporting an inverted U-shaped relationship between the level of urbanization and the shadow economy. From a policy perspective, our results suggest that countries that are not yet experiencing a threshold level of urbanization need to quickly accelerate this process to have a smaller shadow economy.

Keywords: Bayesian analysis, urbanization, tiger cub economies, shadow economy.