

第13回「パネル調査・カンファレンス」報告

水谷 徳子

(公益財団法人 家計経済研究所 研究員)

坂口 尚文

(公益財団法人 家計経済研究所 次席研究員)

1. 第13回「パネル調査・カンファレンス」について

公益財団法人家計経済研究所では、2001年より「パネル調査・カンファレンス」を毎年開催している。第13回にあたる2013年度のカンファレンスは、12月25日にホテルグランドヒル市ヶ谷にて開催された。このカンファレンスは、パネル調査を実施している機関ならびに研究者が集まり、各自の研究成果の報告や、パネル調査の実施や分析にあたっての諸問題を議論する場となっている。

今回のカンファレンスでは、家計経済研究所が実施している「消費生活に関するパネル調査」を用いた研究報告、ならびに共催機関として参加している慶應義塾大学パネルデータ設計・解析センター〔特別推進研究〕、大阪大学社会経済研究所行動経済学研究センター、東京大学社会科学研究所からも、例年通りそれぞれの調査結果の報告が行われた。また今回は新たに、厚生労働省の「中高年者縦断調査」の個票を利用した成果報告が加わり、計5つの報告がなされた。当日のプログラムは図表-1の通りである。

2. 各報告の概要

以下では第13回「パネル調査・カンファレンス」での各報告の概要をプログラムの順番に沿って紹介する。午前の部では、本カンファレンスの共催機関である大阪大学社会経済研究所行動経済学研究センター、慶應義塾大学パネルデータ設計・解

析センター〔特別推進研究〕、東京大学社会科学研究所がパネル調査の研究成果の報告を行った。

平田憲司郎氏（神戸国際大学経済学部）からは、「年齢と時間割引」と題した報告が行われた。異時点間の選択といった時間の経過を考慮した動学的な経済問題を考える上で、時間割引率は重要なパラメーターである。代表的個人モデルをはじめとする多くの経済理論モデルにおいて、単純化のために時間割引率は時間を通じて一定と仮定することが多い。

本報告は、時間割引率が年齢とともに変化する可能性やその変化の程度について、大阪大学21世紀COE／グローバルCOEプログラムの一環として実施された「くらしの好みと満足度についてのアンケート」の2005年から2010年の調査結果を用いて分析したものである。時間割引率の年齢効果を推定する際にパネルデータを用いるメリットは、コーホート効果と年齢効果の識別が可能となる点や個人の属性による年齢効果の程度の違いを明らかにできることにある。

主な結果としては、以下の5点が示された。(1) 時間割引率は年齢に関してU字型の形状をとる（若年期から中年期に低下し、中年期から老年期にかけて上昇する）、(2) 寿命の違いを考慮するため年齢の代わりに平均余命を用いた場合も、時間割引率は余命に関してU字型の形状をとる、(3) 時間選好率の年齢および余命による変化は、女性の方が大きい、(4) 余命で推定した場合、時間割引率が上昇に転じるタイミングには男女差がある（男性：余命

図表-1 第13回パネル調査・カンファレンス（敬称略）

| | | |
|---|--|---|
| 【主催】： 公益財団法人 家計経済研究所 | | |
| 【共催】： 慶應義塾大学パネルデータ設計・解析センター [特別推進研究]・ 大阪大学社会経済研究所行動経済学研究中心・一橋大学経済研究所・東京大学社会科学研究所 | | |
| 【日時】： 2013年12月25日（水）10:30～15:10 | | |
| 【会場】： ホテルグランドヒル市ヶ谷 | | |
| 10:30～10:35 | 開式の辞 | 江崎 芳雄（公益財団法人 家計経済研究所） |
| 司会：樋口 美雄（慶應義塾大学商学部） | | |
| 10:35～11:10 | 「年齢と時間割引」 | 平田 憲司郎（神戸国際大学経済学部） |
| 11:10～11:45 | 「短時間勤務制度義務化と育児女性の離職」 | 深堀 遼太郎（慶應義塾大学大学院・日本学術振興会） |
| 11:45～12:20 | 「時間外労働に対する割増賃金率引き上げの効果」 | 朝井 友紀子（東京大学社会科学研究所） |
| 12:20～13:45 | 昼休み | |
| 司会：村上 あかね（桃山学院大学社会学部） | | |
| 13:45～14:20 | 「男性高齢会社員の雇用形態および退職行動の分析 ——『中高年縦断調査』を利用した固定効果ロジット分析」 | 北村 智紀（ニッセイ基礎研究所） 上村 敏之（関西学院大学経済学部） 中嶋 邦夫（ニッセイ基礎研究所） |
| 14:20～14:55 | 「『消費生活に関するパネル調査』の20年間と今後の課題」 | 田中 慶子（公益財団法人 家計経済研究所） |
| 14:55～15:05 | 「総括」 | 樋口 美雄（慶應義塾大学商学部） |
| 15:05～15:10 | 閉式の辞 | 江崎 芳雄（公益財団法人 家計経済研究所） |

29年、女性：余命36年）、(5) 男性の場合、余命で推定すると老年期の時間割引率の変化が小さい。

これに対し、フロアからは、選択の対象や条件による時間割引率の違い、リーマンショックや東日本大震災の影響とその影響の経時推移について活発な議論が行われた。

深堀遼太郎氏（慶應義塾大学大学院商学研究科・日本学術振興会）からは、「短時間勤務制度義務化と育児女性の離職」と題し、慶應義塾大学パネルデータ設計・解析センターの「日本家計パネル（Japan Household Panel Survey: JHPS）」の2009年から2013年の個票データを用いた分析の報告が行われた。

本報告は、勤務先の短時間勤務制度の設置状況が把握できるという調査の特性を生かし、短時間勤務制度設置の義務化が女性正規社員の育児と仕事の両立にどれほど寄与しているのかを離職の側面と満足度指標を用いた well-being の側面から検

証したものである。育児期の女性正規社員の離職については、離職と出産が同時決定である可能性を考慮し、bivariate probitモデルで分析している。また、well-beingの側面に関しては、固定効果モデルや変量効果モデルによるパネルデータ分析を行っている。

得られた知見を簡潔にまとめると、以下の3点が示された。(1) 短時間勤務制度設置の離職抑制効果は観察されなかった。しかし、(2) 保育所利用児童数に対して待機児童数が多い場合は、短時間勤務制度の設置が離職を抑制する可能性が示唆された。(3) 短時間勤務制度の設置や利用の有無は、仕事の満足度や生活全般満足度を改善させていないことが確認された。

報告に対してフロアからは、第1子と第2子・第3子で影響が異なる可能性や、女性の就業形態の多様化による制度の対応状況、女性の就業環境や他の制度の影響との関連について活発な議論が行われた。

朝井友紀子氏（東京大学社会科学研究所）からは、「時間外労働に対する割増賃金率引き上げの効果」と題した報告が行われた。本報告は、月60時間を超える時間外労働の割増賃金率を25%から50%以上に引き上げた、2008年の労働基準法の改正（2010年4月1日施行）が労働時間の増減にどのような影響を与えたか、その政策評価を行ったものである。用いたデータは東京大学社会科学研究所が実施している「働き方とライフスタイルの変化に関する全国調査（JLPS）」である。

上記の法改正において、中小企業については引き上げの適用が当分の間、猶予されている。そこで、分析では中小企業で働く者をコントロールグループ、引き上げが適用される企業で働く正社員・正職員をトリートメントグループとして、改正前後の労働時間に両グループで違いが見られるかの検証を行った。結果は、両グループ間ともに労働時間増減の影響が見られなかった。ただし、トリートメントグループの範囲を適用企業で月60時間以上時間外労働をしていた人たちに狭めると、同グループの労働時間が若干減少している結果が得られた。朝井氏は労働時間の減少が観測された原因について、その前年に労働時間が増加した可能性をあげている。ただし、観察された効果は過大評価の可能性もあり、今後別のデータでも検証の必要があることを指摘した。

午後の部の最初の発表は「男性高齢会社員の雇用形態および退職行動の分析」と題したもので、研究グループを代表して北村智紀氏（ニッセイ基礎研究所）による発表が行われた。本報告は厚生労働省が実施している「中高年者縦断調査」を用い、2005年に50歳代であった男性の5年間の追跡データから、当該年齢の男性においてどのような要因が雇用形態や退職行動に影響を与えているかを検証したものである。

正社員として就業を継続している傾向が強いのは、「大学・大学院卒」、「有配偶」、「貯蓄を保有している」、「扶養の子どもがいる」といった属性を持つ対象であった。一方、「過去1年に退職経験」がある対象ではパートタイムとして就労して

いるか失業状態である傾向が強、「負債を有する」、「地域活動や文化活動に従事している」対象では自営業に従事している傾向が強い。そして「身内の介護をしている」対象は、パートタイム就労、自営業、失業状態のいずれかである傾向にあった。

報告の最後では、年金減額に対する賃金率、労働時間、月給の各々についての限界代替率を計算した結果も紹介された。大幅な年金減額を伴うような働き方が避けられている結果が得られた。

第2報告は、田中慶子（公益財団法人家計経済研究所）が、『消費生活に関するパネル調査』の20年間と今後の課題」と題し、20年間継続した回答者の特徴と今後の課題に関する報告を行った。「消費生活に関するパネル調査」（以下、JPSCと略）は、1993年から調査を開始し、およそ5年ごとに新規のコホートを追加し、2013年秋には新たなコホートを加えた。開始当初から継続している対象者（コホートAとする）は、2013年時点で20回分のデータが蓄積している（調査は継続中）。本報告では、まず、コホートAの継続回答者の20年間の推移を概観し、(1) 20年一貫して就業している者は約2割、一貫して専業主婦であった者は少数で、再就業する者、あるいは就業と非就業を移行している者が多い。また初回調査時の就業状態により、その後の収入格差が大きくなっている。(2) 家計については、ライフステージの進行に伴い、支出が増加しており、子ども2人以上の世帯では持続的な支出の増加がみられる。一方で、貯蓄ゼロ円の世帯も1割近くで推移している。子どもの教育期と不況が重なったため、少人数の子どもの教育費等は維持しながら、家計のゆとりが少ない世帯がある、という2点を指摘した。

次に20年継続回答者の特徴について検討し、(1) コホートAは、後生コホートに比べて脱落率が低い。(2) 年齢や学歴の偏りはほぼ見られない。(3) 後生コホートと比較して、調査に回答するモチベーションが高いとか、律義であるといった特徴は見られないが、回答時間がやや長い、という3点を指摘した。

他機関も含めて多くのデータが蓄積していく中で、改めて成果を広く社会に還元していくこと、脱落やデータの偏りについても検討していく必要性などを再確認した。

カンファレンスの最後には、樋口美雄氏（慶應義塾大学商学部・「消費生活に関するパネル調査」研究会主査）によるカンファレンスの総括が行われた。多くのパネル調査が実施される中で、データの社会インフラ化、成果の社会的還元の必要性を認識したうえで、データのメーカー、ユーザーというそれぞれの立場からの課題が指摘された。データのメーカーとしての課題は、各データの提供者が「データの質」を向上させること、すなわち、調査の精度の向上である。社会調査をとりまく環境が厳しくなる中で、ひとつの課題として回収率を向上させる必要があるが、どうすれば改善できるのか、調査員、対象者へのアタックの仕方などさまざまな試みが行われているが、これらの結果を機関が連携して活用していくこと。また、パネル調査では、初回のアタック時、調査への諾否のみでなく、2回目以降の回収状況についてもデータのバイアスを調整するうえで、非常に大きな資源となる。このような既存の資源を有効活用しながら、調査の質を高めていくことが期待される。

ユーザーとしての課題は、(1) 国際比較、地域、コーホートの比較を通して、実態を把握していくこと。(2) パネル調査から得られた知見を政策評価・提言につなげていくことである。パネルデータは変化の予測や政策効果の検証に強みをもち、実際、本年の報告でも政策による影響を検証した報告が多くなっているが、近年は研究成果が実際の政策のエビデンスとして活用され、実際に労働や社会福祉政策を動かし始めてきていると評価できるといえる。

調査およびそこから得られる知見を広く社会に還元していくとともに、各機関が連携しながら課題を検討し、パネル調査がさらに発展することが期待されるとしてカンファレンスを締めくくった。

3. まとめ

今回のカンファレンスでは、従来からの当研究所および共催機関である各大学の研究成果の発表に加え、厚生労働省が実施している「中高年者縦断調査」の個票利用成果の発表が行われた。

日本においてもパネル調査が着実に普及・定着していること、そして各大学・研究機関においてパネルデータの蓄積によって分析が可能となり、広く個票の提供も行われ、パネル調査の利用が非常に一般的になりつつあることを実感する。今回のカンファレンスでは、年齢と時間割引、労働政策の変化による雇用環境の変化や労働者の行動の変化など、パネルデータの強みを生かした政策効果の検証や、新たな制度・政策提言への「エビデンス」となる興味深い研究が報告された。

このように研究成果が政策等への活用が期待される一方で、各実施機関は、分析の土台となるパネルデータの品質の維持・向上、そして調査の継続のためのさらなる努力が必要であろう。回答者の継続的な協力を得るための方策、サンプルの偏りの検証や脱落の補正方法の検討など、データの質の向上を目指して、調査の実施やデータ構築に関わる者と分析するユーザーとが連携しながら、研究し改善していくことが求められている。

また、パネル調査が学術的な研究のみならず、社会のインフラとして必要かつ有用であることを示すとともに、得られた知見を広く社会にわかりやすく還元していくことも必要である。

今後も、パネル調査の実施機関ならびにパネルデータ分析に関心をもつ研究者が一堂に集まり、本カンファレンスが、先行してパネル調査を行っている機関から、これからパネル調査を始めようとする機関へと経験を伝達する場、また調査方法・分析方法に関する知識を共有し合える場となることを望んでやまない。

みずたに・のりこ 公益財団法人 家計経済研究所
研究員。応用経済学・応用計量経済学専攻。

さかぐち・なおふみ 公益財団法人 家計経済研究所
次席研究員。労働経済学専攻。