

「特色ある共同利用・共同研究拠点」中間評価結果

大学名	慶應義塾大学	研究分野	経済統計学、応用経済学
拠点名	パネル調査共同研究拠点		
学長名	長谷山 彰		
拠点代表者	山本 勲		

1. 共同研究拠点の概要 ※中間評価報告書より転記

[共同研究拠点の目的]

慶應義塾大学パネル調査共同研究拠点は、すでに活動している慶應義塾大学パネルデータ設計・解析センターを基軸に、国内外の多数の研究者および研究機関の参加を得て、(i) 社会科学における主体行動等の理論仮説に基づき、同一個人や同一家計、企業の行動、経済状況の変化を長期にわたって追跡調査したパネルデータを設計構築し、これを用いて実証分析を行うとともに、(ii) データの整理・管理、および、国内外の研究者に広くデータを公開すること、また、(iii) シンポジウムやセミナーなどの開催を通じてパネルデータによる研究成果の報告やパネルデータの有用性、活用方法を伝播することを目的とする。

[共同研究拠点における成果及び目的の達成状況]

(i) パネルデータの設計構築とこれを用いた実証分析の遂行

慶應義塾大学パネル調査共同研究拠点にてすでに実施している家計パネル調査『日本家計パネル調査 (Japan Household Panel Survey: JHPS)』の調査継続を着実にを行った。JHPSは日本全国の成人男女を対象に、同一個人を長期間に渡り追跡調査したものである。調査項目は多岐にわたり、就業状況や健康状態、所得や資産保有状況、幸福感や教育水準などが盛り込まれており、同一個人を追跡調査することにより、各個人におけるこれらの事項の変化を把握することができる。JHPSの調査は2004年から開始しており、もっとも長いもので13年分のデータの蓄積がある。このように個々人の変化を追えるパネルデータは、日本にいくつか存在するが、そのほとんどが特定の年齢層や性別を対象にしたもので、JHPSのように、日本全国の縮小図になるような長期間にわたるパネルデータは、わが国では他に例を見ない。このようなパネル調査の継続を成功させるためには、調査対象者と信頼関係を構築し、協力を得ることが何よりも重要であり、そのために、毎年12月に調査のフィードバックとしてニュースレターを対象者に配布したり、調査への回答負担の軽減のために調査票の改良を重ねた。2017年度には、調査対象者の家族に関する調査方法の改良を試み、回答負担を軽減するため、昨年度の回答内容を印字する方法を取った。これにより、回答負担を軽減するのみでなく、回答誤差を減少させ、より質の良いデータを構築することが可能となった。また、JHPSデータを利用する研究者への配慮として、モジュール調査の仕組みを設け、拠点の外部の研究者であっても、モジュール調査として、希望の質問項目を調査票に盛り込むことができる機会を設けた。2016年度と2017年度には、一橋大学や中央大学の研究者らの研究チーム、および、武蔵野大学や東洋大学の研究者らの研究チームのモジュール調査を採択し、JHPSの調査票に盛り込んだ。モジュール調査を通して、研究者コミュニティに開かれた拠点の構築を実現した。

本拠点の主要な研究テーマは、パネルデータを用いた経済格差の動学分析である。パネルデータを用いた研究成果も多数公表することができた。2016年6月には、JHPSの付帯調査としてJHPS回答者の子どもを対象に行っている調査『日本子どもパネル調査 (Japan Child Panel Survey: JCPS)』による研究成果をまとめた赤林英夫他編『学力・心理・家庭環境の経済分析——全国小中学生の追跡調査から見えてきたもの』(有斐閣)を出版し、所得格差の拡大や子どもの貧困、教育機会の不平等を通じた世帯間格差の固定化などをテーマとして、追跡調査から得られた豊富なデータを駆使した分析結果を紹介した。『日本経済新聞』や『週刊エコノミ

スト』などでも書評が掲載された。2017年3月には、樋口美雄他編『大学への教育投資と世代間所得移転 奨学金は救世主か』（勁草書房）を出版し、奨学金が教育格差を解消することができるか、JHPSにおける奨学金に関する調査項目や所得情報を用い、奨学金におけるミクロの実証分析の結果を紹介した。2018年1月に出版した、山本勲他編『多様化する日本人の働き方——非正規・女性・高齢者の活躍の場を探る』（慶應義塾大学出版会）では、労働市場の問題について、わが国の様々なパネルデータを活用して実証分析した複数の研究論文が収録されており、『日本経済新聞』でも書評が掲載され、第二刷も増刷された。2018年3月に出版された樋口美雄他著『格差社会と労働市場——貧困の固定化をどう回避するか』（慶應義塾大学出版会）では、JHPSを用いた格差や貧困に関する実証研究が示されている。ほかにも、書籍に限らず、当拠点のメンバーらがJHPSを用いて執筆した論文は、多くの査読付き研究雑誌（Energy Economics, International and Public Economics, Health Policy, Japanese Economics Review等）への掲載や学会報告がなされた。

また、JHPSは、日本の所得に関するマイクロ・データの代表として、経済協力開発機構（OECD）で所得分布に関する分析に利用されている。分析においては共同研究という形で、当拠点も協力し、データの説明や実際の集計作業を行っている。2016年には当拠点の若手研究員をフランス・パリのOECD本部に派遣し、共同研究を進めるにあたっての打ち合わせや基盤構築を行った。共同研究の内容については、OECD(2015) “In it together-Why less inequality benefits all”などで公表されている。また、今夏に報告される新たなOECD報告書においても、貧困や所得格差の動態分析の国際比較として、JHPSを用いて共同研究した内容が掲載される。

(ii) パネルデータの整理・管理と公開

慶應義塾大学パネル調査共同研究拠点では、当拠点が設計構築した『日本家計パネル調査（JHPS）』から得られるパネルデータを、国内外の多くの研究に活用してもらうべく、パネルデータの整理・管理と公開にも創意工夫を行ってきた。なかでも、2017年よりJHPS関連のデータの貸出し作業をオンライン化したことは特筆に値する。従来は、申請書類の郵送提出後、CD-ROMでのデータ提供と事務側にも利用者側にも時間を要する仕組みであったものを、システムを構築することにより、オンライン上でデータ申請とデータ審査、データのダウンロード、データの利用報告ができるようになった。特に、海外のユーザーの利便性が高まったため、外国からのデータの申請件数が増えた。

また、JHPSによる研究成果公表のためのツールであるディスカッション・ペーパーの発行サービスも2017年度にシステムの改修を行い、Eメールでの申請であったものを改め、オンラインでの申請システムに切り変えた。

提供するパネルデータの質の向上にも力を注いだ。パネルデータにおいては、調査回答者が調査協力を継続しないなどにより、年々、対象者数が減る問題（サンプル脱落）が生じる。これによって生じるデータの歪み（バイアス）を修正するために、ウェイトを付けて集計する必要がある。当拠点では、日本の他のパネル調査機関に先駆けて、サンプル・バイアスを修正するためのウェイトの作成を進めている。当初は、外国のパネル調査実施機関における資料を参考に、拠点内の研究員が自らウェイトの作成を試みた。作成したウェイトについては、パネルデータ分析に関する国際学会International Panel Data Conferenceなどで発表したり、世界的なパネルデータ分析の権威である南カリフォルニア大学のCheng Hsiao教授の招聘コンファレンスで発表し、ウェイトの作成におけるアドバイスを求めた。さらに、2016年にはイギリスの大規模家計パネル調査の実施機関であるEssex大学のInstitute for Social and Economic Researchを訪問し、イギリスの家計パネル調査Understanding Societyのウェイト作成担当者のPeter Lynn教授からの助言を受けた。パネルデータのウェイトの作成においては、日本において専門家はいないと言っても過言ではない状況であり、この分野における先駆的機関としての役割を担うべく、諸外国のパネル調査実施機関との連携の構築に尽力している。

パネルデータのユーザーの利便性の向上にも力を注いでいる。慶應義塾大学パネル調査共同研究拠点が提供しているパネル調査『日本家計パネル調査（JHPS）』のデータにおいて、複数年度の調査データを変数ごとに連携し、パネルデータ化する作業は、特殊なデータ構築能力と膨大な時間と労力を要する。ユーザーの利便性を向上するために、単年度のデータをパネルデータ化するプログラムを拠点の研究員らにより作成し、内部関係者全体で確認作業をしたうえで、2017年度よりプログラムの一般公開も実施している。統合プログラムは英語版も提供している。

『日本家計パネル調査（JHPS）』は、日本を代表する所得のマイクロ・データとして、ルクセンブルク所得研究所（Luxembourg Income Study : LIS）にも提供している。LISは、世界各

国の所得のマイクロ・データを収集し、研究者にデータ提供を行っている研究機関であり、所得や資産の国際比較研究などの用途として、世界中の多くの研究者や研究機関に利用されている。LISへのデータ提供により、JHPSの利用者が国外に向けて拡大されたことが予想される。また、LISのデータは、データ提供国の研究者のみ利用することができるため、本拠点が日本の代表としてJHPSをLISに提供したことにより、日本の研究者がLISのデータにアクセスできるようになった。2017年には、LISで2年に1度開催されるデータ提供国の代表者会議に当拠点の研究員が参加し、日本における今後のデータ提供スケジュール等について協議した。

(iii) シンポジウム・セミナーの開催

慶應義塾大学パネル調査共同研究拠点では、パネルデータによる経済格差の動学分析という研究テーマに基づいて、数多くのシンポジウム・セミナーを開催し、学内のみならず、学外の研究者・一般向けに、パネルデータ分析に関する情報を多く発信してきた。以下に主要なものについて概要を述べる。

2016年5月には、「日本の経済格差のダイナミズム：パネルデータによる実態把握」と題して、本拠点の研究者によるパネルデータを使った経済格差に関する分析成果を報告した。所得格差、就業・健康格差、労働市場の二極化・固定化、教育投資の格差と子どもの学力、資産格差と相続、税制による格差解消のマイクロ・シミュレーションなど、幅広い研究テーマにおけるパネルデータを用いたダイナミクスについて分析報告を行った。学内の大規模ホールにて開催し、他大学の研究者や官公庁の政策担当者、メディア、大学院生などにより会場が埋め尽くされた。

2017年3月にニッセイ基礎研究所と共催で行ったワークショップ「厚生労働省パネルデータを用いた経済分析と政策提言」も、他大学の研究者や官公庁の政策担当者、メディア、大学院生など多くの参加者が集まった。このワークショップでは、厚生労働省が実施している3つのパネル調査を用いた研究成果（平成28年度厚生労働科学研究費補助金プロジェクト：代表者山本勲）について、関係者より研究報告を行った。本拠点では、今までのパネルデータ設計・解析に関するノウハウを活かし、これらの縦断調査のデータクリーニングおよびパネルデータ作成のためのプログラムを開発し、厚生労働省の許可のもと、拠点ウェブサイト上で、無償にて公開し研究者の利便性の向上を図っている。

パネル調査共同研究拠点では、各分野における気鋭の研究者を招聘し、ワークショップやセミナーの開催も頻繁に行った。所得格差の研究分野では、長年、OECD（経済協力開発機構）で格差研究を先導しているMichael Forster分析官らを招聘し、パネルデータを用いた所得格差の動態分析の国際比較に関する最前線の研究内容について講義いただいた。学内の研究者・学生、官公庁の政策担当者等、学外からも参加者が多く、延べ99名の参加者があった。

教育関連の分野でも、2017年3月に教育経済学の気鋭の研究者である米国コロロンビア大学Jane Waldfogel教授を招聘し、パネル調査を用いた所得格差と子どもの教育格差に関する研究を講義いただき、本拠点の研究報告に対してもご助言いただいた。また、Waldfogel教授とは、JHPSとJCPSを用いた子どもの教育格差の共同研究の協議も行った。

教育分野においては、中国の家計パネル調査の代表者でもある米国プリンストン大学のYu Xie教授を招聘し、日中韓における家庭環境と教育格差に関するミニコンファレンスを開催した。共同研究の一環として進めているプロジェクトであり、2回のミニコンファレンスを慶應にて開催した。日中韓を中心に、複数の国々から多くの研究者が集い、パネルデータ等を用いた家庭環境と子どもの学力の格差についての研究成果が報告された。

また、世界的なパネルデータ分析の権威である南カリフォルニア大学のCheng Hsiao教授を招聘し、本拠点関係者らの研究報告に対し、ご助言いただく機会も設けた。報告会では、拠点内部の関係者以外にも、東京大学や京都大学の大学院生にも研究報告の機会を提供した。また、Hsiao教授と同時期に招聘した南カリフォルニア大学のJinkook Lee博士においては、2名の招聘者による高齢者の引退と健康状態に関する研究報告を実施した。

2. 評価結果

(評価区分)

A : 拠点としての活動は概ね順調に行われており、関連コミュニティにも貢献していると判断される。

(評価コメント)

日本家計パネル調査 (Japan Household Panel Survey: JHPS) を継続的に行うとともに、当該データを用いた共同研究を通じて、着実に成果を挙げている。また、当該データを国内外の多くの研究に活用してもらうべく、パネルデータの整理、管理と公開に向けた創意工夫を行っている。これらのことから、拠点としての活動は概ね順調に行われており、関連コミュニティにも貢献していると判断される。

具体的には、日本全国の成人男女を対象に、同一個人を長期にわたり追跡調査を行う JHPS について、13 年分のデータの蓄積があり、当該データを用いた経済格差の動学分析を行い、その成果を、書籍の出版や査読付き雑誌への掲載、学会報告に繋げている。さらに、日本の所得データの代表として、経済協力開発機構 (OECD) にて、所得分布に関する分析に利用されるとともに、若手研究員が OECD 本部での共同研究に向けて準備を進めている。

共同利用についても、国内外の多くの研究に活用できるよう、2017 年より関連データの貸出し作業をオンライン化することにより、データ活用の利便性を高め、外国からのデータの申請件数が増えている。

今後は、学内予算による継続的な日本家計パネル調査の実施や、共同利用・共同研究拠点として認定を受けて共同利用・共同研究を実施していることを HP で国内外に広く発信することを通じて、拠点活動を一層活発化することが期待される。