

平成 30 年 6 月 7 日現在

機関番号：34419

研究種目：若手研究(B)

研究期間：2016～2017

課題番号：16K17140

研究課題名(和文) Nonlinear Intergenerational Mobility and Risky Educational Investment

研究課題名(英文) Nonlinear Intergenerational Mobility and Risky Educational Investment

研究代表者

張琳(ZHANG, Lin)

近畿大学・経済学部・講師

研究者番号：80733609

交付決定額(研究期間全体)：(直接経費) 900,000円

研究成果の概要(和文)：本研究では、家庭内の要因という視点から、所得や人的資本など要素の世代間の移転を理論・実証の両面から分析することを目的とする。親の利他性と子どもの習慣形成をモデル化することによって、親の教育行動が子どもの長期厚生水準を増進するメカニズムを解明した。理論モデルの結果を検証し、親の教育行動の決定要因も明らかにした。

研究成果の概要(英文)：This research studies the mechanism behind the nonlinear intergenerational mobility theoretically and empirically from the aspects inside the home. For the theoretical part, a model of parental altruism in relation to children's habit formation is proposed. For the empirical part, it examines and verifies the hypothesis from that parents are more likely to be authoritative if they are from wealthy families.

研究分野：マクロ経済学

キーワード：Human Capital Social Mobility

1. 研究開始当初の背景

(1) 世代間所得弾力性 (intergenerational income mobility) とは、社会流動性 (social mobility) を評価する指標の一つとして、親世代の所得が子世代の所得に影響する程度を意味して、 $\log(\text{子世代の収入})$ と $\log(\text{親世代の収入})$ の相関係数となっている。これは親世代の収入が 1% 上昇すると、その子供の予想される収入にどの程度影響するかを示す指標で、世代間所得弾力性の水準が高いほど社会的流動性が低くなっていることを示している。

従来の経済学理論では、世代間所得弾力性が線形 (linear) であることを想定し、世代間所得弾力性を推定するモデルを構築しました。しかし、近年の実証分析の結果によって、世代間所得弾力が非線形型 (non-linear) であることもあった (例えば、Cardak et al., 2013; Bratsberg et al., 2007; Mazumder, 2005)。上記の研究により、北欧諸国世代間所得弾力が凹状 (concave) であること、アメリカが凸状的 (convex) であることもわかった。世代間所得弾力性の非線形性は社会所得分配の不均一性を示している。

これまでの理論によると、世代間所得弾力性が非線形になる理由について、資本市場における信用制約、教育システムの構造、所得再分配昨日、所得分配の構造などの要因が挙げられた。これらの家庭外の要因を利用して、世代間所得弾力性の非線形性の一部を説明できる。

(2) 世代間所得弾力性の非線形性を説明できる家庭内の要因もある。数多くの実証研究によると、個人の早期の家庭環境や親の経済・社会地位などは将来の所得を決定する要因であることがわかった (例えば、Dornbusch et al., 1987; Baumrind, 1991)。これらの家庭内の要因は所得および世代間弾力性にどのような影響を及ぼすか。これは

一つ重要な課題となっている。

2. 研究の目的

本研究では、家庭内の要因という視点から、所得や人的資本など要素の世代間の移転を理論・実証の両面から分析することを目的とする。

具体的には、以下の課題がある。

(1) 家庭内の要因として、親による教育行動と世代間所得移転について、理論モデルを構築する。

(2) 上記の理論モデルを解析的分析し、子どもの生涯厚生水準への影響を明らかにする。

(3) 日本のデータとの整合性を検証する。理論モデルの結果を再検討する。

3. 研究の方法

(1) 理論研究の部分において、本研究は、親の利他性と子どもの習慣形成をモデル化することによって、親の教育行動が子どもの長期厚生水準を増進するメカニズムを解明する。親による世代間所得移転の制限が子どもの長期厚生水準を増進する必要十分条件を導き出す。

(2) 実証研究の部分において、本研究は、大阪大学 21 世紀 COE プロジェクト「アンケートと実験によるマクロ動学」及びグローバル COE プロジェクト「人間行動と社会経済のダイナミクス」によって実施された「くらしの好みと満足度についてのアンケート」の結果を用い、「厚生を増進する親の利他性と子どもの習慣形成」による理論モデルの結果を検証し、親の教育行動の決定要因を明らかにする。

4. 研究成果

(1) 理論研究

3 期間の世代重複モデルを考える。子どもの消費選好は習慣形成であることと、子どもは第 3 期間 (成人になる期間) まで自分の習

慣形成を認識しないことを仮定する。利他性を持つ親は子どもへの所得移転水準を決定する。子どもの過剰消費傾向を制限するため、親による実際の所得移転水準は子どもが期待する水準を下回ることを示した。

親の教育行動の子どもの長期厚生水準への影響を評価するため、回顧的厚生関数が用いられる。親による実際の所得移転水準と子どもが期待する水準を回顧的厚生関数に代入し、それぞれの長期厚生水準を比較することによって、以下の結果が得られた。親が十分に利他的かつ親の所得水準が十分に高いである場合、親による世代間所得移転の制限が子どもの長期厚生水準を増進する。逆にも成立する。また、子どもの習慣形成パラメータが大きくなれば、親による実際の所得移転水準は更に減少する。

これらの結果は、親による教育行動の重要性を強調した。

(2) 実証研究

子ども時代の家庭の豊かさは、親になった後の教育行動にどのような影響を及ぼすのだろうか。実証分析の結果、消費に関する習慣を認識する場合、被験者の厳格な態度は、彼らの15歳ごろの家庭生活水準と正の相関を持つ傾向があることが明らかになった。更に、主成分分析を用いて、こういった結果は頑健であることが示されている。

参考文献

- Baumrind, D. 1991. Parenting styles and adolescent development. *The Encyclopedia of Adolescence* (pp. 746-758). Garland, New York.
- Bratsberg B, Røed K, Raaum O, Naylor R, Jäntti M, Eriksson T, and Österbacka E. 2007. Nonlinearities in intergenerational earnings mobility: consequences for cross-country comparisons. *The Economic Journal*, 117 (519): C72-C92.
- Cardak BA, Johnston DW, and Martin VL. 2013.

Intergenerational earnings mobility: A new decomposition of investment and endowment effects. *Labour Economics*, 24 (2013): 39-47.

Dornbusch, S. M., Ritter, P. L., Leiderman, P. H., Roberts, D. F., & Fraleigh, M. J. 1987. The relation of parenting style to adolescent school performance. *Child Development*, 58(5), 1244-1257.

Mazumder B. 2005. Fortunate sons: new estimates of intergenerational mobility in the United States using social security earnings data. *The Review of Economics and Statistics*, 87 (2), 235-255.

5 . 主な発表論文等

(研究代表者、研究分担者及び連携研究者には下線)

{ 雑誌論文 } (計 2 件)

① Lin Zhang, Shinsuke Ikeda. (2018) Intergenerational transmission of authoritative parenting style: evidence from Japan. *International Journal of Economics and Finance*. Vol. 10, No. 1, pp.64-73. 査読有 DOI:10.5539/ijef.v10n1p64

② Lin Zhang, Shinsuke Ikeda. (2016) Welfare-enhancing parental altruism and children's habit formation. *International Review of Economics*. Vol. 63(3), pp. 281-303. 査読有 DOI: 10.1007/s12232-016-0255-2

{ 学会発表 } (計 0 件)

{ 図書 } (計 0 件)

{ 産業財産権 }

出願状況 (計 0 件)

名称 :
発明者 :
権利者 :
種類 :
番号 :

出願年月日：
国内外の別：

取得状況（計 0 件）

名称：
発明者：
権利者：
種類：
番号：
取得年月日：
国内外の別：

〔その他〕
ホームページ等

6. 研究組織

(1) 研究代表者

張 琳 （ ZHANG Lin ）
近畿大学・経済学部・講師
研究者番号：80733609

(2) 研究分担者

なし

(3) 連携研究者

なし

(4) 研究協力者

なし