

機関番号：14501

研究種目：基盤研究 (C)

研究期間：2008～2010

課題番号：20530238

研究課題名 (和文) ラテンアメリカにおける家計調査データを用いた所得分配の研究

研究課題名 (英文) Analysis of income distribution in Latin America
using household survey data.

研究代表者

西島 章次 (Shoji Nishijima)

神戸大学 経済経営研究所 教授

研究者番号：70116234

研究成果の概要 (和文)：

本研究は、ラテンアメリカ諸国における経済自由化の効果を、マイクロデータを用いた計量分析で明らかにすることを目的としている。具体的な第1の研究課題は、家計調査データを用い、賃金格差への経済自由化の効果を実証することである。第2の研究課題は、企業データを用い、生産性への経済自由化の影響を実証することである。結論としては、ブラジルなどのラテンアメリカにおいては、経済自由化が所得分配や生産に影響したことが確認された。

研究成果の概要 (英文)：

The purpose of the project is to investigate empirically the consequences of economic liberalization in Latin American countries using micro data. The first main subject is to estimate the impacts of economic liberalization on wage premiums using household survey data. The second subject is to know the influences of changes in openness on productivity employing firm survey data. Our results show that liberalization had significant impacts on income and productivity in Latin America.

交付決定額

(金額単位：円)

	直接経費	間接経費	合計
2008年度	1,100,000	330,000	1,430,000
2009年度	1,000,000	300,000	1,300,000
2010年度	700,000	210,000	910,000
年度			
年度			
総計	2,800,000	840,000	3,640,000

研究分野：ラテンアメリカ経済

科研費の分科・細目：経済学・経済政策

キーワード：ブラジル、家計調査データ、所得分配、賃金プレミアム、経済自由化、所得再分配政策、非正規労働、アウトソーシング

1. 研究開始当初の背景

ラテンアメリカ諸国は、1980年代中頃からネオリベラリズムに基づき、それまでの

政府介入に基づく経済運営から、市場自由化に基づく経済運営へと大きく転換した。しかし、その成果は、経済成長の回復と旺

盛な資金流入を可能とする一方で、失業の拡大、貧困・所得分配問題の悪化など、社会的公正の側面では期待された結果を生み出すものではなかった。したがって、こうした状況にあるラテンアメリカ諸国においては、ネオリベリズムに基づく経済自由化がいかなる影響を与えているかを科学的に実証することが喫緊の課題となっている。

2. 研究の目的

ラテンアメリカ諸国、とくにブラジルにおける貿易自由化が、所得分配、賃金格差、貧困などいかなる影響を与えているかを、家計調査や企業調査のマイクロデータを用いて実証することを目的とする。幸い、ブラジルなどのラテンアメリカ諸国では家計調査が長年にわたり実施されており、しかもCD-ROMで入手可能である。

3. 研究の方法

基本的な研究方法は、貿易自由化や資本自由化などの進展が、経済の openness の拡大とともに、雇用、賃金、分配構造にいかなる変化が生じているかを明らかにすることである。具体的には、各種の賃金格差や所得格差の計量分析にあたり、教育、経験年数、勤続年数、職種、産業、地域、正規・非正規雇用、男女などの個人の属性をコントロールした上で、経済の openness の指標を追加して、その指標がどのように、賃金格差や所得格差を説明するかを実証することである。経済の openness の指標としては、輸出比率、輸入比率、直接投資、中間財輸入比率、資本財輸入比率、海外展開の程度、関税引下げ率などを用いて作成する。また、貿易自由化や資本自由化などが、企業の生産性・TFP にどのような影響を与えているかを実証することも重要な課題である。TFP の算出にあたっては、Aw(2001)、Good, et

al. (1997) などの総要素生産性指標や、Battesse et al. (1995) で開発されたストックキャストティック・フロンティア分析を用いて TFP を算出する。また、経済の自由化、開放度のみならず、国内市場の競争条件、技術者比率、企業固定効果なども考慮して実証される。

4. 研究成果

重要な研究成果は、以下の4点である。

(1) ブラジルの家計調査データ (PNAD) を用い、製造業 21 業種の賃金プレミアムを計測し、産業特性による所得分配への影響を明らかとしたことである。まず、ミンサー型賃金関数の推定において、産業ダミーによって産業の賃金プレミアムを推定し、第2段階では、これの決定要因分析を行い、経済自由化の賃金プレミアムへの影響を実証した。その結果、産業賃金プレミアム(労働者の能力などの特質では説明されないが、産業によって説明される賃金部分)のばらつきが増加傾向にあり、賃金格差の拡大要因として作用していたことが確認された。また、第2段階の産業賃金プレミアムの決定要因分析の推定において、とくにブルー・カラー労働者のみを対象として推定された産業賃金プレミアムに関しては、輸入比率、関税率、直接投資比率などの開放度の変化が産業賃金プレミアムの変化に対して有意に影響していることが明らかとなった。したがって、ブラジルでは開放度が高まってきたことが産業賃金プレミアムを拡大させる一つの要因となったと考えることができる。ただし、関税率の漸進的な引き下げは産業賃金プレミアムを低下させることも明らかとなった。

(2) 世界銀行の企業データを用い、貿易自由化の企業の生産性への効果を、総要素生産性指標や確率フロンティア分析によって算出した TFP を用いて実証したことである。企

業のオープンネスの指標のみならず、技術者比率や非生産労働者比率が生産性に有意であることが明らかとなった。これにより明らかとなったいくつかの点を列挙すると、

①ブラジル企業のTFP改善への効率性改善と技術進歩の寄与率は、それぞれ0.583と3.587であり、技術進歩による寄与が圧倒的に大きかった。

②TFP成長に対し、オープンネスの影響として、輸出企業であること、輸入資本財・輸入投入財を利用していること、外資の資本参加があることが強く有意であった。1993-99年の関税引下げ率の影響は認められるが、輸入競争は負の関係にあり、海外進出の影響は認められなかった。

③関税引き下げに関しては、各産業の関税引き下げ指数、産業ダミーともに有意であった。したがって、貿易自由化が一巡した2000年代以降も、関税の引き下げが生産性改善に影響しているといえる。

④技術的効率性(TEC)に対しては資本財輸入を除き、オープンネスの指標は強く有意であるとはいえなかった。このことは技術的効率性の改善には本章では考慮されなかった要因が存在することを示唆している。

(3) 第3点は、ブラジルにおける貿易自由化とTFPとの関係、ブラジル・コストと呼ばれるインフラや制度的要因とTFPとの関係を、World Bankが提供する企業マイクロデータを用いて実証的に検討したことである。貿易自由化とTFPの関係は明確であると考えられるが、実質的に2年間のデータであり、パネル分析を用いては十分な実証はできなかったことや、また、貿易自由化の効果を代理させた企業のオープンネスの様々な変数がデータの制約からtime invariantであり、十分に活かすことができなかったことが今後の課題であるが、輸出企業であることや、

関税引き下げ率を代理する産業ダミーの一部がTFPのレベル、TFPの変化のいずれの回帰においても有意であり、貿易自由化の重要性をある程度は説明できたといえる。また、ブラジル独自の制約要因に関しても、電力制約、労働制約、信用制約が有意に影響している可能性を示された。しかし、こうした制約要因に関しては交差項の適切さなどの問題があり、必ずしもロバストな推定であるとはいえず、今後の課題である。また、企業のオープンネスとTFP、輸出とTFPの間に内生的な関係が存在することが予想されることから、こうした点も今後の課題である

(4) 本研究の研究期間(平成20年~22年)における研究成果を、『ブラジルにおける経済自由化の実証研究』というタイトルで体系的に取りまとめたことである。家計調査データ、企業データなどを用い、ブラジルにおいて経済自由化やそれに基づくskill biased technical changeが生産性や所得分配などにどのように影響したかについての我が国で初めての体系的な研究となったと考えている。また、経済自由化が地域間格差にどのように影響するかについて家計調査データを用い、空間経済学の観点から明らかとしたことも重要である。なお、本書においては、以上の問題に加え、ブラジルのサトウキビ産業で進展する機械化と雇用の関係をパネル分析を用いて検証し、また、貿易自由化と国内市場、消費者金融の関係を、自動車産業を事例としてその効果を検証した。

今後の課題は、他のラテンアメリカ諸国においても同様の実証を行い、比較研究を進めることである。とくに、メキシコやチリでも家計調査データが利用可能であり、既にメキシコに関する賃金格差の研究を実施しており今後はこうした比較研究を実施する。

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7件)

- ① 西島章次、浜口伸明「ブラジルにおける貿易自由化と産業賃金プレミアム」、『国民経済雑誌』、査読無、203巻3号、2011年、1-15.
- ② Atsushi Fukumi, Shoji Nishijima, “Institutional quality and foreign direct investment in Latin America and the Caribbean,” *Applied Economics*, 査読有、Vol.42, No.14, 2010, 1857-1864.
(<http://www.lib.kobe-u.ac.jp/repository/90001057.pdf>)
- ③ 劉文君、西島章次「確率的フロンティア分析を用いたブラジル企業の生産性の実証研究」RIEB Discussion Paper Series、査読無、DP2010-J01、2010、1-17.
(<http://www.rieb.kobe-u.ac.jp/academic/ra/dp/Japanese/dp2010-J01.pdf>)
- ④ 浜口伸明「ブラジル国内人口移動の新傾向：2008年世帯調査から」『国民経済雑誌』、査読無、201巻3号、2010、67-80.
- ⑤ 西島章次「ブラジルのサトウキビ産業とその雇用に関する実証研究」『国民経済雑誌』、査読無、199巻6号、2009、29-44.
- ⑥ 西島章次「ブラジルにおける経済自由化と生産性—企業データによる実証分析」『国民経済雑誌』査読無、199巻1号、2009、1-16.
- ⑦ 浜口伸明「ブラジルの経済成長における消費者金融の役割」『国民経済雑誌』査読無、199巻1号、2009、17-28.

[学会発表] (計3件)

- ① 西島章次、「ブラジルにおける貿易自由化と産業賃金プレミアム」ラテン・アメリカ政経学会第47回全国大会報告、2010年11月14日、慶應義塾大学湘南藤沢キャンパス.
- ② 西島章次、「世界経済危機：ラテンアメリカの視点」ラテン・アメリカ政経学会第46回全国大会シンポジウム、2009年11月29日、立命館大学.
- ③ 西島章次、「ブラジル（メルコスール）の進展と日本との関係」ラテン・アメリカ政経学会第45回全国大会シンポジウム報告、2008年12月7日、上智大学 四谷キャンパス.

[図書] (計1件)

- ① 西島章次、浜口伸明『ブラジルにおける経済自由化の実証研究』神戸大学経済経営研究所 研究叢書、No.72、2011、1-156.
(<http://www.rieb.kobe-u.ac.jp/academic>

/ra/researchseries/research_ser/research_ser72.pdf)

[その他]

ホームページ等

<http://www.rieb.kobe-u.ac.jp/~nisijima/index.html>

6. 研究組織

(1) 研究代表者

西島 章次 (Shoji Nishijima)
神戸大学経済経営研究所 教授
研究者番号：70116234

(2) 研究分担者

浜口 伸明 (Nobuaki Hamaguchi)
神戸大学経済経営研究所 教授
研究者番号：70379760