

長期失業の発生メカニズムと 問題の整理

——理論的な考察

三谷 直紀

(岡山商科大学教授)

本稿では長期失業の発生メカニズムと長期失業がもたらす問題について主に理論的な文献を展望した。長期失業者割合の上昇の要因は、大まかに失業期間平均の退出率の低下と退出率の負の失業期間依存性の高まりに分けることができる。失業期間平均の退出率の低下は全般的な失業の増大とほぼ同じ要因による。一方、退出率の負の期間依存性をもたらす要因としては、①求職者に異質性がある場合、採用選抜の方法として失業期間が労働者の能力を示す情報として用いられるため、長期失業者の退出率が低くなるというスクリーニング仮説、②求職者に異質性がなくとも求人に複数の求職申込みがある場合、最も失業期間の短い者を選ぶため、長期失業者の退出率が低くなるというランキング・ルール仮説、③失業中に労働者の技能や就業意欲が低下するために、退出率に負の期間依存性が生じるという仮説、④仮に費用をかけて失業中に能力を維持する失業者がいたとしても企業は長期失業者を差別するために長期失業者の退出率が低くなるという仮説、などがある。また、失業による技能低下は特に経済に構造的な変化が起こっている時期に大きいため、長期失業が発生しやすいことが指摘されている。長期失業がもたらす問題としては、長期失業の増加は賃金を上昇させること、また、失業の持続性を高めること、さらに、所得格差を拡大させること、そして、長期失業は失業者の幸福度を大きく下げること、などがある。

目次

- I はじめに
- II 長期失業の推移
- III 長期失業の動的な分析と失業期間依存性
- IV 長期失業の発生メカニズム
- V 長期失業がもたらす問題
- VI おわりに

I はじめに

本稿では、長期失業が生じるメカニズムと長期失業にともなう問題を整理する。

近年 OECD 諸国で長期失業に対する関心が高まっている。その背景には、リーマンショック後景気回復が遅れる中で OECD 諸国の長期失業が増加していることがある。とりわけ、ユー

ロ危機で深刻な経済状態に陥った南欧諸国を中心に失業の長期化が大きな問題となっている (OECD 2012)。また、アメリカでは戦後最悪の長期失業者の増加が大きな関心を集めている (Krueger, Cramer and Cho 2014; Kroft, Lange and Notowidigdo 2013 など)。これまで労働市場の流動性が高く、失業率は高いものの短期失業者が多く、長期失業の問題が大きく取り上げられることはなかった。今回の景気後退期における長期失業者の際立った増大は何らかの労働市場の構造変化を示している可能性もある。日本では、失業率は低いものの長期失業者の割合は他国と比較して低くない。特に、若年の長期失業者割合が高いのが特徴である。

長期失業は失業者本人にとって大変深刻な問題である。また、社会にとっても人的資源が長い間

使われないことは大きな損失である。長期失業が発生するメカニズムを明らかにし、適切な政策を講じていくことは、きわめて重要である。長期失業はさまざまな問題をもたらす。中でも長期失業の増大によって、失業が持続的なものに転化することや所得格差が拡大することは社会の効率性や公平性の面で深刻な問題である。どのような問題が長期失業によってもたらされるのであろうか。

本稿の構成はつぎのようである。まず、次節ではOECD諸国における長期失業の推移を概観する。ⅢではDuration Analysisの理論的フレームワークをもとに、長期失業比率と失業からの退出率の関係や退出率の失業期間依存性の概念を定式化する。Ⅳでは、長期失業の発生メカニズムに関する最近の理論的研究をサーベイする。Ⅴでは、長期失業のもたらす問題を整理する。最後はまとめである。

Ⅱ 長期失業の推移

長期失業者といった場合、通常失業期間半年以上あるいは1年以上の失業している場合を指す場合が多い。失業期間には失業状態が終了した時点の完結失業期間と『労働力調査』等で調査される失業状態から退出していない時点の中途失業期間があるが、前者はデータ入手が困難な場合が多いため、後者の失業期間を用いる。特に断らない限り、本稿で扱うデータの失業期間は中途失業期間である。

OECD諸国の全失業者に対する長期失業者の割合をみると、ヨーロッパ、日本で高く、北米、北欧で低い(表1)。ヨーロッパの国々では、特にギリシャ、スペイン、ポルトガル、イタリアなど、南欧諸国で高い。総じて失業率の高い国で長期失業者割合も高い。しかし、日本やドイツのように、失業率が低くても長期失業者割合の比較的高い国もある。

男女別にみると、長期失業者割合はどの国でも

ほぼ同じであるが、例外的に日本とアイルランドでは男性の長期失業者割合が女性よりもかなり高い。

時系列でみると、長期失業者割合はヨーロッパでは1970年代後半から上昇し、1980年代から40～50%前後とかなり高い水準で高止まっていた。長期的にみるとやや低下傾向がみられたが、2009年以降また上昇している(図1)。アメリカでは、1980年代から2008年まではほぼ10%前後の低い水準であったが、リーマンショック後急上昇し、2011年には31.3%に達した後やや低下している。戦後これまでで最も高かったのは1983年の13.3%であった。これに比べると今回の不況期の長期失業者の増加は戦後例のない突出したものであった。日本は、1980年代初めから1990年代初めにかけて10%台後半で推移していたが、1990年代半ば以降2003年頃まで上昇を続けたあと33%前後で横ばいとなり、リーマンショック後40%まで上昇している。以上のように日米欧で長期失業者割合の動向を比較すると、①1990年代半ば以降の日本での持続的上昇と②リーマンショック後のアメリカでの急激な上昇が特に目立った変化である。

年齢別にみると、総じて年齢が高くなるにつれて長期失業者割合は高くなっている(表2)。しかし、若年層でも30～40%以上の高い長期失業者割合となっている国が日本や南欧諸国を中心にかなりある。若年層の長期失業者割合は2003年には10年前と比較して低下している国が多く、景気変動の影響を受けやすいことを示唆している。しかし、日本では過去20年間ほぼ一貫して若年の長期失業者割合が上昇している¹⁾。

失業率と長期失業者割合の関係をみると強い相関関係がある。クロスセクションでみると表1の2013年のデータで相関係数は0.694となっている。また、日本とアメリカの時系列のデータでも強い相関があることがわかる(図2、図3)。

表1 主な OECD 諸国の長期失業者割合（失業者計に占める割合）と失業率（2013年）

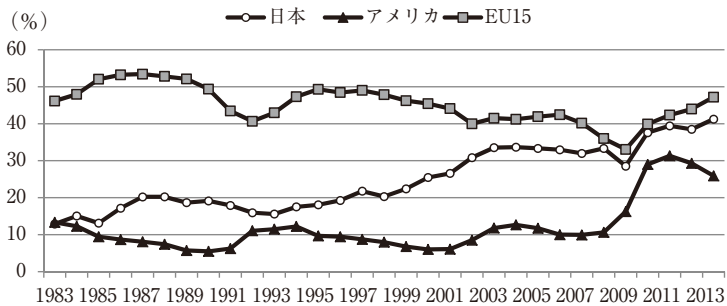
（単位：％）

	男女計			男			女		
	6カ月以上	1年以上	失業率	6カ月以上	1年以上	失業率	6カ月以上	1年以上	失業率
日本	56.0	41.2	4.1	63.9	48.7	4.3	43.4	29.3	3.7
アメリカ	37.6	25.9	7.4	38.1	26.4	7.6	37.0	25.3	7.1
EU15	63.8	47.2	11.0	64.3	47.6	11.0	63.3	46.7	10.9
オーストラリア	34.2	19.2	5.7	35.3	20.1	5.7	33.0	18.1	5.6
オーストリア	43.4	24.3	4.9	43.4	25.4	4.9	43.3	23.2	4.9
ベルギー	63.8	46.0	8.4	64.5	46.5	8.6	62.9	45.4	8.2
カナダ	22.3	12.7	7.1	22.5	12.9	7.5	22.1	12.5	6.6
デンマーク	41.9	25.5	7.0	39.4	23.5	6.7	44.5	27.5	7.3
フィンランド	36.0	21.2	8.2	39.8	23.6	8.7	31.3	18.1	7.6
フランス	59.4	40.4	9.9	60.1	40.8	10.0	58.7	39.9	9.8
ドイツ	60.3	44.7	5.3	60.9	45.4	5.6	59.4	43.8	4.9
ギリシャ	81.1	67.5	27.3	80.7	66.4	24.3	81.4	68.6	31.3
アイルランド	74.9	60.6	13.8	79.5	67.2	15.8	67.0	49.3	11.4
イタリア	71.4	56.9	12.2	72.0	56.8	11.5	70.7	57.1	13.1
ルクセンブルク	48.8	30.4	5.8	49.1	30.5	5.4	48.5	30.4	6.4
オランダ	54.7	35.9	6.7	55.3	36.3	7.1	53.9	35.3	6.3
ニュージーランド	31.9	12.1	6.2	33.2	13.6	5.6	30.7	10.7	6.9
ノルウェー	28.7	9.2	3.5	29.5	10.5	3.7	27.8	7.5	3.3
ポルトガル	73.2	56.3	16.2	73.8	57.5	16.0	72.5	54.9	16.4
スペイン	67.0	49.7	26.1	66.4	48.9	25.6	67.8	50.5	26.7
スウェーデン	33.0	17.0	8.0	35.4	18.7	8.2	30.1	15.0	7.9
イギリス	53.4	36.3	7.7	56.5	39.8	8.2	49.4	31.6	7.0

注：EU15 地域の国は、オーストリア、ベルギー、デンマーク、フィンランド、フランス、ドイツ、ギリシャ、アイルランド、イタリア、ルクセンブルク、オランダ、ポルトガル、スペイン、スウェーデン、イギリスである。

資料出所：OECD.Stat

図1 日米欧の長期失業者割合^{注)}の推移



注：失業期間1年以上の失業者の全失業者に占める割合

資料出所：表1に同じ。

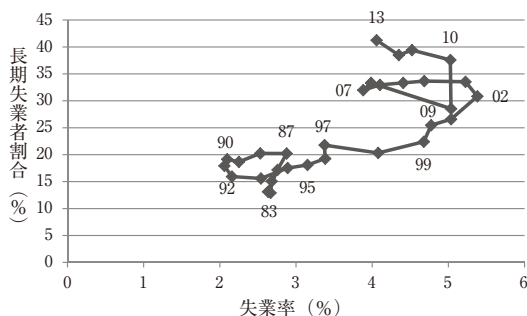
表2 主な OECD 諸国の年齢別長期失業者割合^{注)}

(単位：%)

	1993年			2003年			2013年		
	15-24歳	25-54歳	55歳以上	15-24歳	25-54歳	55歳以上	15-24歳	25-54歳	55歳以上
日本	10.0	22.7	25.0	28.2	40.8	42.1	36.8	52.6	45.2
アメリカ	5.5	16.2	23.6	8.0	13.4	20.4	17.7	28.6	35.4
EU15	33.9	42.3	52.5	26.4	43.1	57.4	35.5	49.1	60.8
オーストラリア	28.7	44.1	59.8	14.0	28.9	46.1	15.5	20.0	34.3
オーストリア	—	—	—	10.6	23.6	54.3	13.4	25.9	53.0
ベルギー	27.7	51.1	73.5	25.3	50.1	72.2	29.8	49.8	68.1
カナダ	9.9	18.7	27.7	3.7	11.0	20.8	5.7	13.2	18.6
デンマーク	12.3	24.6	44.2	9.6	25.2	43.4	9.3	27.9	38.2
フィンランド	16.8	37.9	39.7	7.5	32.3	53.8	7.4	26.5	45.2
フランス	18.2	33.5	63.2	24.0	42.9	60.3	28.1	43.1	55.2
ドイツ	19.1	37.8	48.2	25.5	49.5	63.7	24.0	45.6	62.5
ギリシャ	37.3	44.0	45.4	41.9	49.3	59.9	53.9	67.6	73.7
アイルランド	51.9	67.2	71.9	24.3	45.2	49.6	48.7	70.4	77.3
イタリア	57.4	53.8	51.8	55.0	59.7	62.2	55.8	56.4	62.8
ルクセンブルク	—	35.7	—	26.2	34.2	22.5	28.0	28.9	50.0
オランダ	42.2	54.9	74.1	12.9	29.6	55.0	19.2	36.8	55.1
ニュージーランド	26.9	43.4	59.3	6.5	19.0	32.7	6.3	18.3	22.9
ノルウェー	14.3	28.9	40.0	2.4	8.6	16.5	3.4	12.8	31.2
ポルトガル	27.5	41.4	58.3	20.5	35.3	50.1	40.2	58.3	75.4
スペイン	31.0	39.7	52.4	22.4	28.6	52.1	41.6	48.2	65.3
スウェーデン	11.2	18.7	33.4	6.8	19.5	40.0	5.9	24.9	31.3
イギリス	35.6	51.4	55.2	12.6	31.0	40.7	32.2	43.9	48.5

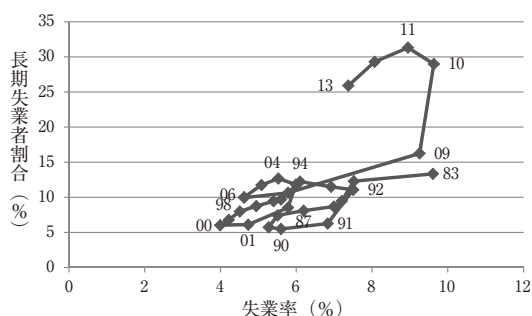
注：失業期間1年以上の失業者の全失業者に占める割合
資料出所：表1に同じ。

図2 失業率と長期失業者割合の関係（日本）



資料出所：表1に同じ。

図3 失業率と長期失業者割合の関係（アメリカ）



資料出所：表1に同じ。

Ⅲ 長期失業の動態的分析と失業期間依存性²⁾

この節では、長期失業を分析する理論的フレームワークを提示し、長期失業を考える上で重要な失業からの退出率や失業期間依存性の概念を定式化する。

1 持続期間分析

ここでは、理論的フレームワークとして、持続

期間分析(Duration Analysis)の分析手法を用いる。つまり、失業からの退出率(ハザード率=労働者が失業から脱する瞬時的な退出確率)から出発して、他のすべての関数を表す方法をとる。失業期間 t における失業からの退出率を $h(t)$ とする。この時、退出率は他の観察可能な性質に依存するとすることも可能であるが、ここでは簡単化のためにこのことを仮定しない。退出率関数 $h(t)$ は、個々の観察できない異質性を取り除いた後の誘導形と解釈できる。また、失業から雇用あるいは非労働力人口への流出率と考えることもできる。もし、退出

率が失業期間に依存して決まるのであれば失業期間依存性 (duration dependency) があるという。そして、失業期間が長くなると退出率が低下するという関係にある時、負の期間依存性があるという。

$G(t)$ を完結失業期間の確率分布とする。すなわち、 $G(t) \equiv \Pr(T < t) \equiv$ 任意の失業者の完結失業期間 T が t より短い確率とする。 $g(t) \equiv G'(t)$ をこの分布の密度関数とする。このとき、瞬時的退出率関数 $h(t)$ はつぎのように定義される。この定義は、期間 t 時点でまだ失業から退出していない失業者が期間 t と $t + \Delta t$ の間の瞬時的な時間 Δt の間に退出する確率が $h(t) \Delta t$ で与えられるということの意味する。

$$\begin{aligned} h(t) &\equiv \lim_{\Delta t \rightarrow 0} \Pr(t \leq T < t + \Delta t | t \leq T) / \Delta t \\ &= \lim_{\Delta t \rightarrow 0} \frac{G(t + \Delta t) - G(t)}{\Delta t (1 - G(t))} = G'(t) / (1 - G(t)) \\ &= g(t) / (1 - G(t)) \end{aligned}$$

したがって、つぎの関係式を得る。

$$1 - G(t) = \exp\left(-\int_0^t h(s) ds\right)$$

ここで注意しなければならないのは、統計データでは中途失業期間で長期失業者比率を計測しているが、上記の失業期間の分布は完結失業期間である。しかし、中途失業期間でとった長期失業者割合と完結失業期間でとった確率分布 $G(t)$ の間には、つぎに示すようにある簡単な関係式が成り立つ。

まず、定常状態でこの関係式を導出する。すなわち、単位期間における失業への流入数が一定の N で、かつ失業からの退出数も一定であるとする。現在失業期間 t である失業者は t 期間前に失業者となっており、それ以降仕事が見つからなかった者である。こうした失業者は $N[1 - G(t)]$ だけいる。したがって、現在 (中途) 失業期間が t よりも長い失業者の失業者全体に占める割合 $P(t)$ はつぎの式で与えられる。

$$P(t) = \int_t^\infty [1 - G(s)] ds / \int_0^\infty [1 - G(s)] ds$$

この時、つぎの命題が成り立つ。

命題 1

$$\frac{\partial \ln P(t)}{\partial h(s)} = P(s) - 1 < 0 \quad s < t \text{ の場合}$$

$$\frac{\partial \ln P(t)}{\partial h(s)} = P(s) \left(\frac{P(t) - 1}{P(t)} \right) < 0 \quad s \geq t \text{ の場合}$$

(証明略)

この命題の意味するところは、長期失業者割合は、長期失業者の退出率の変化にだけによって変化するのではなく、あらゆる失業期間の失業者の退出率の変化によって変化するということである。

したがって、長期失業者割合は、①失業期間平均の失業からの退出率と②退出率の失業期間依存性によって決まると考えられる。前者は長期失業者割合が平均退出率の減少関数であることを意味している。また、後者は失業からの退出率の失業期間依存性、すなわち失業からの退出率が失業期間によって異なっており、長期失業者割合はその影響を受けるということである。

後者の関係をさらに詳しく定式化するとつぎのようになる。 z を失業からの退出関数に影響を与える変数とし、退出関数を $h(t, z)$ とする。対応する失業期間の分布関数を $G(t, z)$ 、密度関数を $g(t, z)$ とする。この時、 τ を適当な任意の期間として、もし、 z が $t \leq \tau$ となる t に対して退出率を引き上げるように作用し、そして、 $t > \tau$ となる t に対して退出率を引き下げるように働くならば、失業からの退出率の負の期間依存性が強まったと考えることは自然な定義である。その時、つぎの命題が成り立つ。

命題 2

もし、 $t \leq \tau$ である t に対して、 $h_z(t, z) \geq 0$ が成り立ち、かつ $t > \tau$ となる t に対して、 $h_z(t, z) < 0$ となる場合、長期失業者の割合は増加する。(証明略)

これまで、失業への流入が変化しない状態で長期失業者割合を分析するフレームワークを考えてきた。しかし、失業への流入が変化する場合はそのような影響が考えられるであろうか。単純化のために、失業からの退出率は変化せず、流入率だけが変化する場合を考えてみよう。 $N(s)$ を期間 s 時点での失業への流入を表すとする。 τ 時点での失業構造をみると、 s 時点で失業した者のうち、 τ 時点で仕事が見つかっていない者は $N(s) [1 - G(\tau - s)]$ である。

したがって、 τ 時点で失業期間が t の長期失業者割合を $P(t, \tau)$ とすれば、次のように与えられる。

$$P(t, \tau) = \int_t^{\infty} N(\tau-s) [1-G(s)] ds / \int_0^{\infty} N(\tau-s) [1-G(s)] ds$$

もし、最近時点で失業への流入が多ければ、長期失業者割合は減少する。失業の流入は、景気変動により増減するため、長期失業者割合の変動をもたらすことになる。

実際、日米の長期失業者割合と失業率の関係を詳しくみると、失業率が先行して動いており、その後を追って長期失業者割合が変化している。その結果、散布図は時計の反対回りの円を描くように動いている（前出図2、図3）。

2 失業期間依存性

どの国でも、失業からの退出率の負の失業期間依存性が観察できる（Machin and Manning 1999）。しかし、真の期間依存性と観察されない労働者の異質性に起因する期間依存性を区別する必要がある。

真の期間依存性とは、長期失業者は仕事を見つける機会が低いこと、すなわち、誰であれ、失業して不幸にして仕事が見つからず失業期間が長くなればなるほど失業からの退出率が低下することである。これに対して、観察されない異質性が失業者の間にある場合、見かけ上失業期間が長くなれば失業からの退出率が低下するという関係が観察される。たとえば、二種類の労働者がいて、それぞれの失業からの退出率がそれぞれ h_0 、 h_1 ($h_0 < h_1$) であると、時間とともに変化しないものとする。ただし、観察者にはこの二種類の労働者の異質性は観察されないものとする。この時、期間 t における第一のグループの失業者に占めるシェアを $s(t)$ とすれば、失業者全体の失業からの退出率は、 $h(t) = s(t) h_0 + (1 - s(t)) h_1$ で与えられる。第一のグループの退出率は第二のグループより低いので、失業者に占めるシェア $s(t)$ は t とともに増大する。したがって、失業者全体の退出率 $h(t)$ は、失業期間 t が長くなれば、次第に低下し、見かけ上負の期間依存性があるように見える。

IV 長期失業の発生メカニズム

失業からの平均的な退出確率が低いことと退出確率が負の期間依存性が存在することが長期失業者割合を高める主な要因と考えられる。前者は一般的な失業率が高いことの要因と重なる。一般的な失業の要因の理論的な分析については、本稿の範囲を超えるものであり、他の文献（Layard, Nickell and Jackman 2005; Bean 1994; 黒田 2001; 太田・玄田・照山 2008 など）を参照されたい。これらの文献では、要因として、総需要の不足、手厚い社会福祉の給付、労働組合の強い交渉力、高い最低賃金、解雇規制、技能偏向的技術進歩、グローバル化などがあげられることが多い。

ここでは主に失業からの退出確率が失業期間とともに低下するという負の期間依存性がどのようなメカニズムによって発生するのかを検討する。これには、企業側の要因として、長期失業者を何らかの（合理的または非合理的な）理由によって生産性の低い労働者と見なして採用しないことによって、長期失業者の退出率が低いことを説明する理論がある。一方、労働者の側で失業期間が長くなるにつれて、仕事が見つからないことに落胆して職探しの意欲を失うことや失業期間が長くなるにつれて技能が低下していくことによって、失業期間が長くなるということを説明する理論がある。さらに、失業保険制度や解雇規制等の制度的要因も考えられる。これらの要因は互いに排他的なものではなく、実際には相乗的に作用して長期失業者の退出率が低下することが示されている。

以下ではこれらの理論を概観することによって、長期失業が発生するメカニズムを明らかにする。

1 労働需要側の要因

企業の採用政策として長期失業者を何らかの理由で差別して採用しないために長期失業者の退出率が低いという理論がある。

(1) スクリーニング仮説

Lockwood (1991) は企業の採用者選抜の過程において、失業期間が労働者の能力のシグナルと

なるために負の期間依存性が発生するとする理論を構築した。このモデルでは労働者の異質性を仮定している。企業は採用に当たり、労働者の能力を知るためにテストを行う。もし、いくつかの企業がテストの結果によって採用者を選抜しているのであれば、選抜に漏れた労働者の能力は相対的に低いことになる。したがって、失業期間の長さは労働者の能力を示すシグナルとなりうる。つまり、労働者の能力が他の企業に知られるという外部性があることになる。企業は自ら行うテストの結果と失業期間という情報をもとに、労働者を選抜し、採用する。当該企業のテストの結果が同じであれば、失業期間の短い労働者を優先的に採用する。結果として、失業者の失業からの退出率は失業期間が長くなればなるほど低くなる。

この論文では企業が採用試験によって労働者を採用する状況を考えている。この場合、採用されなかった労働者の生産性に関する情報が他の企業に伝わるという外部性が発生する。そして、他の企業はその情報をもとに、採用を決めることができる。すなわち、フリーライドすることができる。そして、失業期間が一定期間よりも長い場合には採用しないという方法で、生産性の高い労働者を採用することができる。

このような状態が均衡として永続的であるためには、フリーライドされても企業が試験を行う誘因があることが必要である。この論文では、このような均衡がどのような条件の下で存在するか、そしてその性質を詳しく分析している。その結果わかったことは、第1に、試験によって生じた情報は常に使われるということである。しかし、もし、企業が試験を行うことに利益を見出したとしても、ある一定期間以上の失業期間の長期失業者を採用しないことがやはり企業の利益となる。第2に、労働需給の状況によって、採否を決定する失業期間の臨界値は変化することである。労働需給がひっ迫すればするほど、失業期間の臨界値は短くなる。さらに、求人維持していく費用が低いほど、失業期間の臨界値は短くなる。

このような結果は、再就職確率の負の失業期間依存性の存在を説明するものである。失業からの退出率の負の期間依存性は、供給側の要因によっ

ても説明できる可能性がある。たとえば、失業の長期化に伴う就業意欲の低下や技能の陳腐化である。しかし、長期失業者に対する差別の存在も指摘されている。非合理的な差別による場合は、参入が自由で競争的な産業ではこの現象は解消するはずである。このモデルは、合理的な差別による説明を提供し、したがって、それに対処する対策を議論するための理論的フレームワークを明らかにしたとしている。

もし、労働者の能力に異質性があって、失業期間が長い労働者がより低い能力を持っている可能性が高い場合に、もし、この異質性が研究者にはわからないが企業は観察できるものであれば、必ずしも市場の失敗を意味するものではない。しかし、異質性に関する私的情報がある場合はこの選抜方法は、一種の外部性を持ち込み、したがって、政策的な対応がパレート改善をもたらすかも知れない。

しかし、労働者に異質性がない場合にも失業期間依存性(真の期間依存性)が生じる場合がある。労働者が事前的に同質であったとしても、ひとつの求人に複数の求職申し込みがあった場合、最も失業期間が短い者を採用するという採用方法(後出のランキング・ルール)を行ったり、あるいは、労働者が失業期間中に技能を失って、事後的に異質になる場合である。

(2) ランキング・ルール仮説

Blanchard and Diamond (1994) は、企業がひとつの求人に対して複数の求職者があった時、その中で最も失業期間の短い労働者を採用するという採用方法(ランキング・ルール)をとる場合と失業期間に関係なくランダムに採用する場合と比較して、失業、失業期間分布および賃金がどのようになるかを分析している。結果は、まず、ランキングがある場合には、失業期間が長くなると失業からの退出率が低下する(負の期間依存性がある)という自明の結果に加えて、失業率の高い不況期ほど、期間依存性が強くなるということを明らかにした。労働需給がひっ迫していれば、求職者の求人に対する比率は小さい。したがって、ほとんどの求人はひとつまたはゼロの求職申し込みがある。したがって、長期失業者は短期失業者とほ

ほぼ同じ就職確率がある。一方、労働需給が緩和してくると、求人に対する求職者の数が増え、ひとつの求人に対する応募者の数が多くなる。したがって、長期失業者は短期失業者よりも著しく就職する確率が低くなる。企業の長期失業者に対する態度が問題である。つまり、失業期間が長くなることによる技能の低下はかなり軽微であっても求職者の行列の中で、最も失業期間の短い者を雇うという行動（ランキング・ルール）を企業がとれば、長期失業が持続的になる可能性がある。

つぎに賃金への影響である。賃金が将来の失業期間に依存するため、長期失業者の存在それ自体は賃金への影響はほとんどない。このようなランキング・ルールで企業が採用をしている場合には、仮に失業しても再雇用の優先順位が高いため現在雇用されている労働者は賃金交渉においても強い立場に立つことができる。したがって、ランキング・ルールを適用しない場合に比べて、均衡賃金が高くなる。さらに、ランキング・ルールの下では経済ショックが賃金により大きな短期的効果を持つ。

2 労働供給側の要因

(1) 人的資本の減耗・職探しの意欲の喪失

失業期間中に技能や職探しの意欲が低下するとすれば、失業からの退出確率に期間依存性をもたらす。失業期間が長くなるにつれて労働者の能力が低下し、企業が採用しなくなり、また、失業者の職探しの意欲がなくなってくることから、失業から雇用への移行確率は低下するという考え方である。

Acemoglu (1995) は、失業期間中に技能を維持するか、あるいは低下するままにしておくかは労働者が内生的に選択するモデルを構築した。事前的に同質の労働者がいて、失業期間中に技能を維持するためには労働者は一定の費用を負担しなければならない、また、労働者が失業期間中に技能を維持したかどうかは直接的に観察できず、採用後の短期訓練期間が終了してはじめてわかるという仮定を置いた。この仮定の下で、ふたつの均衡があることを示した。ひとつは、「技能喪失均衡」(skill-loss-equilibrium) である。この均衡では、す

べての長期失業者は、高技能部門の企業から差別の対象となり、これを予見して、長期失業者は高技能部門での雇用に必要な技能を維持する費用を負担しない。そのため、この部門の企業は採用の際に長期失業者を差別する。もうひとつの均衡は「技能非喪失均衡」(non-skill-loss-equilibrium) である。この均衡では、採用決定は労働者の失業期間に無関係である。技能喪失均衡では、長期失業者は短期失業者より失業からの退出確率が低くなる。いいかえれば、負の期間依存性がある。また、技能非喪失均衡と比較して定常状態の失業率と長期失業者割合は高く、厚生は低い。

技能喪失均衡にあるとき、労働政策が必要である。賃金助成や積極的差別是正策、労働市場政策（再訓練）が考えられる。しかし、助成政策や民間部門による積極的差別是正策は一般に効果がない。賃金助成を行うと企業は機会が来るとすぐに採用した長期失業者を解雇するインセンティブがある。そうすると、長期失業者の方もあえて失業期間中に技能を維持しよとしなくなる。これに対して、政府部門による積極的差別是正策や労働市場政策（訓練政策）は効果がある可能性がある。積極的差別是正策として長期失業者を政府部門で雇用するという政策のもとでは、長期失業者は政府部門で雇用されるよう技能を維持する。したがって、均衡では民間の高技能部門でも長期失業者を採用するようになる。政府が採用し、テストするというコミットメントがあれば、長期失業者は進んで技能を高めようとする。しかし、政府の再訓練プログラムという形での労働市場政策は、効果はあるものの、労働者が技能を維持しようとするインセンティブが減少するため、それよりパレート効率性の高い均衡が存在する可能性がある。労働市場政策によってよりパレート効率性の高い均衡に移行することがより難しくなる。対照的に、政府による積極的差別是正策は、適度に用いられている限り、そのような移行を可能にする。

Ljungqvist and Sargent (1998) は、失業期間中に労働者の技能が低下し、職探しの意欲が下がることによって長期失業が生じることを一般均衡サーチモデルを用いて示した。とりわけ、第二次石油危機後のヨーロッパのように、失業保険など

の社会福祉が充実した福祉国家において大きな経済ショックに見舞われた時、構造不況業種の勤続年数の長い労働者が解雇され失業すると、これまでの技能の価値が大きく失われ、新しい産業の職に就くために必要な技能を獲得するために時間がかかる。また、失業保険給付が前職の（高い）賃金に応じて支払われることによって、留保賃金も高く、職探しの意欲も弱くなる。1980年代以降西欧諸国で長期失業が増大した大きな要因を大きな経済ショックに見舞われた福祉国家における失業者の技能の喪失と職探しの意欲の低下にあるとしている。

(2) 閑散市場の外部性

失業期間中に労働者の技能が低下すると仮定すれば、必然的に退出率の負の期間依存性が導かれ、失業が持続的となる。しかし、現実に西欧諸国で観察された失業の持続性を示すに十分な長さの効果を持ちうるかは疑問である。当該ショックで失業した者が再雇用されれば、こうした理由による失業の持続性はそれほど長くはないと思われる。実際、西欧諸国でも平均失業期間はそれほど長くはない。

Pissarides (1992) は、失業中に労働者の技能が低下すると仮定した上で、労働市場に閑散市場の外部性 (thin market externality) が現れることによって、この弱点が補えることをサーチ理論で示した。そして、マクロの雇用が定常状態から乖離する状態が持続的なものとなり、失業期間が長くなること、さらに経済ショックは雇用・失業状態を新たな均衡に永続的にシフトさせる可能性があることを導出した。そのメカニズムは、次の通りである。労働者の技能が失業中に低下すると、企業にとってより好ましくなくなる。そうすると、つぎの期に来る求人は少なくなる。失業者は全体としてより低い人的資本しかもっていないことから市場は、閑散市場（求人が少なく、求人と求職のマッチングも少ない状態）になる。負の経済ショックがあると、求人数は過去のトレンドよりも少なくなることから新世代の失業者の失業期間はトレンドよりも長くなり、人的資本が低下する。したがって、仮に古い失業者がすべて失業から退出しても、市場は閑散なままである。閑散市場はさら

なる求人不足を招き、それがさらに市場の閑散さを持続させる。このように、ショックの影響が持続し、もし、閑散市場の外部性が十分大きければ、経済は低いレベルの均衡状態に陥る可能性がある。複数均衡は、規模の収穫一定の生産とマッチング技術の下でも存在しうる。

3 制度的要因

長期失業が生じる要因として、制度的な要因を考えてみよう。

(1) 失業保険制度

失業保険制度があると、失業給付が支給されることによって労働者の消費が失業前後で平準化され、失業保険制度がない場合より経済厚生が高まる。また、失業期間中も所得があることで適職を探す余裕ができ、結果として適職につける可能性が高まる。すなわち、保険としての効果である。しかし、一方で失業給付があることで職探しに対するインセンティブが低まり、一生懸命職探しをしようとせず、失業期間が長くなる効果がある。保険とインセンティブの相反する効果をどのように調整するかが失業保険制度の運用と制度設計の要点である。

部分均衡サーチ理論によると、失業給付が失業からの退出率に与える効果はつぎのようになる (Tatsiramos and van Ours 2014)。失業者は、職探しを続ける費用と便益をバランスするところで留保賃金を選び、そしてそれと求人との条件を比較して、求人申し込みを受け入れるかどうかを決める。給付水準が上がれば、留保賃金は高まる。そして、そのことは失業からの退出率を下げ、失業期間を長くする。より手厚い失業給付に対するこうした失業者の反応はモラルハザード効果と呼ばれている。職探しの努力という変数をモデルに入れても主要な効果は変わらない。失業給付を引き上げると、留保賃金上がるだけでなく、職探しの努力が低くなることによって失業からの退出率は低下する。失業給付の所定給付期間が決まっている場合には、給付期間が終了する前に失業の価値が下がり、留保賃金の低下を通して退出率が上昇する。所定給付期間の延長は、留保賃金を上昇させ、平均失業期間を長くする。

一方、給付水準の上昇は所定給付期間の残存期間によって失業者の行動に異なった影響を与える。所定給付期間の場合と異なって、給付の代替率（失業前の給与に対する失業給付額の比率）の上昇は、失業期間の初めに最も大きな影響を与える。失業したばかりの失業者にとって失業給付の代替率の上昇は、失業の価値が高まることによって、失業からの退出率を低める効果を持つ。仕事のオファーを受諾するのにより高い賃金を要求するようになる。一方、失業給付の所定給付期間の終わりに近い失業者にとってより高い給付は、受給資格効果（eligibility effect）³⁾によってより高い退出率に繋がる。

(2) 解雇規制

解雇規制は、企業の雇用調整の費用を高め、退職管理や採用行動に影響を与える。一般に、解雇規制が厳しいと、解雇が少なくなって失業への流入率が低くなる。一方、解雇が難しくなるため企業の採用行動が慎重になり、採用も抑制される。したがって、失業からの退出率も低くなる。したがって、長期失業者比率が高くなる。こうした効果は失業からの平均退出率が低下する効果である。解雇規制によって退出率の負の失業期間依存性が強まるかどうかは理論的に定かではない。解雇規制が上述のような長期失業者に対する企業の差別行動とどのような関係にあるのかどうかという点も今後の検討課題であると思われる。

V 長期失業がもたらす問題

最後に、長期失業がもたらす問題について整理する。長期失業は個人にとっても社会にとっても深刻な状態であり、さまざまな問題が生じる。そこで、まず、賃金や失業の持続性、所得格差といったマクロでみた経済社会における問題についてみたあと、個人の幸福度にどのような影響を与えるかをみてみたい。

1 賃金への影響

長期失業者は賃金にどのような影響を与えるのであろうか。Machin and Manning (1999) は、Shapiro and Stiglitz (1984) 型の効率賃金仮説を

用いて、時間割引率が正の場合に、失業水準が任意の水準にある場合に、失業からの退出率の負の期間依存性が強まると賃金が高くなることを示している。直感的な説明は次の通りである。労働者が怠けることを防ぐためには、それが見つかって解雇され、失業した場合の効用を下げるのが企業にとって望ましい。このことは、新規に失業に入った時点での失業の価値を下げるのが望ましいことを意味する。任意の与えられた失業水準で、負の失業期間依存性が強まることは、長期失業者の退出率を相対的に下落させ、短期失業者の退出率が相対的に上昇させることを意味している。したがって、労働者が将来の価値を割り引くのであれば、失業期間が短い時の失業の価値がより大きなウェイトを持ち、したがって、新規に失業することの価値が上がる。この場合は怠けることを防ぐために賃金水準は高くしないといけないことになる。つまり、賃金は上昇する。同様な結果が、上述のように Blanchard and Diamond (1994) など他の理論的な研究でも得られている。

このことはいくつかの実証研究でも確かめられている (Machin and Manning 1999)。また、リーマンショック後の不況下でアメリカで観察されている長期失業者割合の上昇とフィリップス・カーブのシフトとの関係と整合的である (Krueger, Cramer and Cho 2014)。長期失業が賃金決定に影響を与えないで、賃金が増えることは長期失業者の失業からの退出がさらに困難になることを意味している。

2 長期失業と失業の持続性

長期失業は失業の持続性とも関係している。たとえば、ランキング・ルールの効果は定常状態ではあまり大きくなくとも短期的には大きくなる場合がある。特に、突然景気が回復した場合、失業からの退出率の負の期間依存性があると、短期失業者の就職確率が高まり、賃金の上昇を招く。そのことは長期失業者の失業状態が持続することになる (Blanchard and Diamond 1994)。また、上述のように、Pissarides (1992) も、サーチ理論を用いて、失業者が失業中に少しでも技能を失うとすれば、閑散市場の外部性が働き、短期的なショック

クが持続的な失業を引き起こす場合があることを示した。

3 所得格差

失業は所得の低下を意味する。長期失業者割合が高いということは、失業の負担が少数の労働者に集中していることを示している。このことは、長期失業が所得格差の拡大に寄与していることを示唆している。

しかし、厳密に格差との関係を考えるのであれば、長期失業者だけでなく、失業を繰り返す労働者も考慮する必要がある。そのためには、パネルデータを用いて一定の期間のうち、失業の期間が一定の割合の労働者にどれだけ集中しているかを示す必要がある。Machin and Manning (1999)は、ドイツ、イギリスおよびアメリカの1990年代のデータを用いて分析し、失業や不就業の期間は特定の労働者に集中する傾向があること、そして長期失業者割合の高い国でその傾向が強いことを示している。

4 幸福度

失業は個人の幸福度に負の影響を与える。所得水準を同じにしてもその傾向はみられる(大竹2004)。長期失業の場合はどうであろうか。リーマンショック後のアメリカの失業者を追跡調査した調査の結果では、失業期間が長期化するにつれて失業者は気落ちし、悲しみが増すことが報告されている(Krueger and Mueller 2011)。特に、職探しという事象(episode)に関する回答では、失業期間の長期化が悲しみが増す度合いが高いこと、また、職探しに費やした時間が多かった日の翌日ほど生活満足度が低いことなどが明らかになっている。そして、長期の失業のあと一生懸命職探しを行った結果仕事が見つからないと、職探しの心理的なコストが増加し、多くの失業者を落胆させているのではないかと指摘している。

VI おわりに

長期的にみると、長期失業者割合は1970年代後半から1980年代にかけて西欧諸国で、また、

1990年代以降日本で大幅に上昇し、高止まっている。そして、アメリカでも2008年以降歴史的な上昇をした。

本稿では長期失業の発生メカニズムと長期失業がもたらす問題について主に理論的な文献を展望した。要点はつぎの通りである。

(1) どの失業期間における失業からの退出率の低下も長期失業者割合の上昇をもたらす。また、長期失業者割合の上昇の要因は、失業期間平均の退出率の低下と退出率の負の失業期間依存性の高まりに大まかに分けることができる。

(2) 失業期間平均の退出率の低下は全般的な失業の増大とほぼ同じ要因による。したがって、長期失業者割合と失業率の間には強い相関関係がある。長期失業の発生要因の多くは、全般的な失業を増大させる要因である。

(3) 退出率の負の期間依存性の発生要因は労働需要側の要因、労働供給側の要因、さらに制度的要因にまとめることができる。そのうち、労働需要側の要因によるものとしては、①求職者に異質性がある時の選抜(スクリーニング)の方法として失業期間が労働者の能力を示す情報として用いられるため、長期失業者の退出率が低くなるという選抜仮説、②求職者に異質性がなくとも求人へ複数の求職申込みがある場合、最も失業期間の短い者を選ぶ(ランキング・ルール)ため、長期失業者の退出率が低くなるという仮説、などがある。

(4) 労働供給側の要因によるものとしては、①失業期間中に労働者の技能が低下し、就業意欲が低下するために、仮に費用をかけて失業期間中に能力を維持する失業者がいたとしても企業は長期失業者を差別し、長期失業者の退出率が低下するという理論、②失業期間中の失業者の技能が低下すると、閑散市場(求人が少なく、求人・求職のマッチングも少ない市場)の外部性によって、短期の経済ショックがあると持続的な長期失業が発生するという仮説、などがある。また、失業による技能低下は特に経済に構造的な変化が起こっている時期に大きいため、長期失業が発生しやすいことが指摘されている。

(5) 制度的な要因としては、失業保険制度と解雇規制がある。失業保険制度の所定給付期間を延

長することは失業期間を延ばす効果がある。また、失業給付水準の上昇は、短期失業者の退出率を低め、失業給付期間満了間近の受給者の退出率を高める。

(6) 長期失業がもたらす問題としては、まず、賃金への影響としては、長期失業の増加は賃金を上昇させる効果がある。また、長期失業の増加は、失業の持続性を高める効果がある。さらに、所得格差を拡大させる効果がある。そして、個人にとって長期失業は幸福度を大きく下げる。

日本では、長期失業者割合がバブル崩壊後の長期不況下で上昇し、高止まっている。しかも若年層での変化が大きい。その背景には、日本の雇用システムの中で企業による長期失業者に対する差別やランキング・ルール等の存在があることが考えられる⁴⁾。長期失業の発生メカニズムのさらなる理論的解明と実証分析を踏まえた適切な政策的対応が求められる。

- 1) 篠崎 (2004) は、学歴別には中学卒で長期失業者割合が高いことを指摘している。
- 2) この節は Machin and Manning (1999) によるところが大きい。命題の証明についてはこの文献を参照されたい。
- 3) 就職後再度失業した時の受給資格を得るために、受給資格のない失業者や所定給付期間終了間際の受給者の就職するインセンティブが高くなり、退出率が高くなる効果 (Tatsiramos and van Ours 2014: 291)。
- 4) 本稿では長期失業といわゆる「世代効果」の関係については論じていない。しかし、上述の Acemoglu (1995) の理論モデルは、新規学卒一括採用の慣行の下での「世代効果」の発生メカニズムを示唆するものとしてその政策提言も含めて興味深い。

参考文献

- 大竹文雄 (2004) 「失業と幸福度」『日本労働研究雑誌』No. 528, pp.59-68.
- 太田聡一・玄田有史・照山博司 (2008) 「1990年代以降の日本の失業：展望」日本銀行ワーキングペーパーシリーズ。
- 黒田祥子 (2001) 「失業に関する理論的・実証的分析の発展について——わが国金融政策へのインプリケーションを中心に」『金融研究』第20巻第2号, pp.69-121.
- 篠崎武久 (2004) 「日本の長期失業者について——時系列変化・

- 特性・地域」『日本労働研究雑誌』No.528, pp.4-18.
- Acemoglu, D. (1995) "Public Policy in a Model of Long-term Unemployment," *Economica*, New Series, Vol. 62, No. 246, pp. 161-178.
- Bean, C. R. (1994) "European Unemployment: A Survey," *Journal of Economic Literature*, Vol. 32, pp. 573-619.
- Blanchard, O. and P. Diamond (1994) "Ranking, Unemployment Duration, and Wages," *Review of Economic Studies*, 61, pp. 417-434.
- Kroft, K., F. Lange and M. J. Notowidigdo (2013) "Duration Dependence and Labor Market Conditions: Evidence from a Field Experiment," *Quarterly Journal of Economics*, 1123-1167.
- Krueger, A. B., J. Cramer and D. Cho (2014) "Are the Long-Term Unemployed on the Margins of the Labor Market?" Brookings Panel on Economic Activity, March 20-21.
- Krueger, A. B. and A. Mueller (2011) "Job Search, Emotional Well-Being, and Job Finding in a Period of Mass Unemployment: Evidence from High-Frequency Longitudinal Data," *Brookings Papers on Economic Activity*, Spring.
- Layard, R., S. Nickell and R. Jackman (2005) *Unemployment: Macroeconomic Performance and the Labor Market*, 2nd ed., Oxford University Press, Oxford.
- Lockwood, B. (1991) "Information Externalities in the Labour Market and the Duration of Unemployment," *Review of Economic Studies*, 58, pp. 733-753.
- Ljungqvist, L. and T. J. Sargent (1998) "The European Unemployment Dilemma," *Journal of Political Economy*, Vol. 106, No. 3, pp. 514-550.
- Machin, S. and A. Manning (1999) "The Causes and Consequences of Longterm Unemployment in Europe," in O. Ashenfelter and D. Card eds. *Handbook of Labor Economics*, Volume 3, pp.3085-3139.
- OECD (2012) *Employment Outlook*, OECD Publishing, Paris.
- Pissarides, C. A. (1992) "Loss of Skill during Unemployment and the Persistence of Employment Shocks," *Quarterly Journal of Economics*, Vol. 107, No. 4, pp. 1371-1391.
- Shapiro, C. and J. E. Stiglitz (1984) "Equilibrium unemployment as a worker discipline device," *American Economic Review*, 74 (4), pp.892-893.
- Tatsiramos, K. and J. C. van Ours (2014) "Labor Market Effects of Unemployment Insurance Design," *Journal of Economic Surveys*, Vol. 28, No. 2, pp. 284-311.

みに・なおき 岡山商科大学経済学部教授。最近の主な論文に、「OECDにおける労働政策の形成と展開」『日本労働研究雑誌』No.640, pp.65-75, 2013年。労働経済学専攻。