

# 經濟論叢

第155卷 第2号

---

- いわゆる「寛容令」(1787年)の  
意義について(1)……………木 崎 喜代治 1
- ハイエクと主観主義……………江 頭 進 24
- ケインズの哲学と経済学……………斎 藤 隆 子 40
- 日本植民地期の台湾人産業資本に  
関する一考察……………洪 詩 鴻 59
- 

平成7年2月

京都大學經濟學會

## ケインズの哲学と経済学

斎藤隆子

### はじめに

ケインズ (John Maynard Keynes) の初期の著書に『確率論』(A Treatise on Probability, 1921)<sup>1)</sup>があるが、ケインズが20歳代のほとんど全てをかけた学問領域は、経済学ではなく確率の哲学であった<sup>2)</sup>。その序文にあるように、G. E. ムーア、B. ラッセルといった20世紀初頭のケンブリッジ合理主義の直接的影響下にそれは生まれながらも、また一方でロック以来のイギリス経験論の伝統を継ぐものであることも明記されている。ケインズの経済学を考察するにあたり、ケインズの哲学、特に合理性、蓋然性、帰納法についての哲学を理解することが重要である。それまでの確率の考え方を否定し、ケインズ独自の合理性概念に基づく確率理論を提示したケインズと、マーシャル・ピグーの伝統にある経済学を否定し『一般理論』を提示したケインズは、共に同じ哲学的基盤

- 1) 以下引用文において TP と略記する。また、The General Theory of Employment, Interest and Money は GT。その他の The Collected Writings of John Maynard Keynes は CW と略記し、その巻数をつける。
- 2) ムーア「倫理学原理」出版の翌年1904年1月(ケインズ21歳)それへの批判としてケインズは確率の研究を始める。'Ethics in relation to conduct' という論文で論理的概念を提唱しこれが確率論の第一ステップを成す。従って、ブレイスウェイト (Braithwaite)、ハロッド (Harrod) のインド省勤務の1906年から確率の仕事を始めるという記述は誤りである。その後 'Scheme for an essay on the principle of probability' が第二ステップを成し、ケンブリッジのキングスカレッジのフェロー資格論文用に本格的に準備される。1908年フェロー資格取得に失敗するが(試験官は Jonson, Whitehead)、翌1909年 'The Principle of Probability' でフェロー資格を取得する。1910年には『確率論』の出版を決意し、1911年(ケインズ29歳)にはほぼ完成(30章のうち27章)していたが、出版は内外の事情により1921年まで延期されることになる。従って『確率論』は出版年ではケインズの3番目の著作ではあるが、1907、1908年論文の修正と拡張であるので、実質はケインズの最初の著作物である。O'Donnell (1989) 参照。

に基づくように思える。近年、初期哲学を含む総合的ケインズ研究が行われており<sup>3)</sup>、「ケインズ問題」と言われるものに代表される、前期—後期ケインズ連続・非連続説を巡り論争も行われているが、本稿では直接その問題には立ち入らず、ケインズの合理性に関する哲学を明示することにまず力点を置き、「不確実性」・「合理性」概念を中心に、前期ケインズの哲学を代表するものとして『確率論』を、後期ケインズを代表するものとして『一般理論』を選び、ケインズの哲学で変化したもの、依然として連続しているものを論証してみる。第1節では、ケインズの確率概念を説明し、第2節では、それを基に経済学における「不確率性」概念を再構成する。第3節では主体の行為における合理性を『確率論』『一般理論』と比較し、ケインズの哲学の連続性・非連続性を考察する。

## I ケインズの確率の哲学の理念と特徴

『確率論』は合理的信念についての理論を提示する。日常の推論は何らかの意味において合理性を持つている。まるで気まぐれで主観的な訳でもなく、何らかの客観性をもつ。ケインズは推論過程を論理 (logic) に還元することにより、合理的推論の構造を探ろうとした。ケインズにとり確率とは推論過程における合理的信念の度合なのである。ここでケインズの確率を考察する前に、確率の主要理論を概観しておく。確率の主要理論には、(1)古典確率、(2)相対頻

3) 1980年代から、ケインズの包括的研究が始まっている。主なものに以下のものがある。

T. Lawson & H. Pesaran (ed) (1985) *Keynes Economics: Methodological Issues*, Routledge

Carabelli, A. M. (1988) *On Keynes Method*, Macmillan

A. Fitzgibbons (1988) *Keynes's Vision*, Clarendon Press

O'Donnell (1989) *Keynes: Philosophy, Economics and Politics*, Macmillan

B. Bateman & J. Davis (ed) (1990) *Keynes and Philosophy*, Edward Elgar

O'Donnell (ed) (1991) *Keynes as Philosopher-Economist*, Macmillan

B. Gerrard & J. Hillard (ed) (1992) *The Philosophy and Economics of J. M. Keynes*, Edward Elgar

ケインズの確率概念に注目したものには、伊藤 (1966)、北川 (1948)、佐藤 (1970)、竹内 (1983)、塩沢 (1983) がある。早くも積極的に『確率論』と経済学の関連を提唱したのは、Shackle (1949)、山田雄三 (1950)、菱山泉 (1967a, 1967b, 1968, 1989) がある。

度確率, (3)論理確率, (4)主観確率, (5)公理的確率, の5理論がある。その特徴は、図1のようにまとめられる。

図1

確率理論	確率の定義	客観性	完全な数値化	信条 (belief)
(1) 古典確率	先験比	×	○	×
(2) 相対頻度確率	頻度	○	○	×
(3) 論理確率	合理的信頼度	○	×	○
(4) 主観確率	信頼度	×	○	○
(5) 公理的確率	測度	○	○	×

歴史的には、ケインズ以前には、(1)古典確率と(2)頻度確率しか存在していない。(1)古典理論は18世紀、ベルヌーイ (Bernoulli) 19世紀、ラプラス (Laplace) により確立された。確率は、全ての同程度に確からしいケースの数に対する有利な (favourable) ケースの割合として定義される。そのとき、一つのもが他のものより起こり得ると予想する理由がないならば、それらの事象の生起は同程度に確からしいとする「不十分理由の原理」(principle of non-sufficient reason) が使用される。つまり、この理論は主観の無知に立脚する。また無意識に反復試行の経験を前提にしている。この主観と頻度が混在していることの批判から、客観化への二つの流れ、(2)頻度確率(3)論理確率という流れがでてくる。

ケインズの批判の主な対象は、エッジワース (Edgeworth) ベン (Venn) などの(2)頻度確率である。頻度理論は、ケインズ『確率論』の後、1930年代後半からミーゼス (R. Mises)、ライヘンバッハ (Reichenbach) により厳密に定式化され、今日の数理統計学の基礎として確立する。この概念では確率はアポステリオリに数値的測定可能な反復的試行、または同種の物の多数観察にも代用される。確率は事象における頻度すなわち自然の属性として客観的経験的真実に結び付けられる。そこでは主観によるのではなく、経験が唯一の根拠とされる。その結果我々の確信からは独立に数値的確率が得られるのである。従って

4) 確率理論の哲学的基礎については、Weatherford (1982), O'Donnell (1989, 1991) 参照。

我々の推論の基礎を何ら説明するものではなく、「生活のガイド」たりえない。ケインズが求めたのは実際に合理的行為決定への「生活のガイド」として役に立つ確率であった。ケインズは確率を1組の命題間の論理的関係と考え、帰納推理を正当化する基礎を考察した。

それでは『確率論』で展開された論理確率を具体的に見ていく。論理確率の特徴は以下のようにまとめられる。

- 1) 確率は経験的手段によらずアプリオリに決定される。
- 2) 確率は2つの命題間の論理的関係であり、命題自体の特質ではない。つまり確からしさ (certainty) は論理関係であり、命題の性質を表す真 (truth) と同じではない。(合理性と真実の切り離し)
- 3) 確率は合理的信念の度合を示す。単なる信念ではない。この点で心理的な実践的決定理論より規範的決定理論に本質的に関わる。
- 4) 論理関係であり個人から独立しているという意味で客観確率である。

ケインズはこの論理関係つまり合理的信念の度合を「前提  $h$  の知識が結論  $a$  における合理的信念の度合  $\alpha$  で正当化するならば  $a$  と  $h$  の間に度合  $\alpha$  の確率関係があるといい  $a/h = \alpha$  と書く」(TP p. 4) として  $a/h$  (または  $P(a/h)$ , これを略して  $P$ ) と表す。確率が certain の時  $a/h = 1$ , また impossible の時  $a/h = 0$  となり確率の上限と下限が存在する。また確率が possible の時  $0 < a/h < 1$  とされる。結論  $a$  が前提  $h$  に支持される蓋然性が有る場合を、つまり、 $0 \leq a/h \leq 1$  を扱うのを帰納論理と言う。しかし論理関係と、その値がいかにか決定されかがわかったならば確率の定義を持ってそうであるが、ケインズは確率の定義は不可能であるとする。なぜなら、確率はそれ以上単純な概念に分析できない概念であり、直覚によってのみ把握が可能だと考えるのである<sup>5)</sup>。

5) (TP p. 8) これは明らかにムーアの分析哲学における「善の定義不能性」の影響を受けたものである。ムーアは善はそれ以上単純な概念に分解できないので定義不能とし自然的存在により記述したり定義することを「自然主義の誤謬」とする。これは善を快楽により定義する快楽主義的功利主義批判を主な目的とした。そのような非自然的性質の認識方法は、その価値物を直覚ノ

またこの論理確率には、ラッセルの影響を挙げられる。ラッセル・ホワイトヘッドの『プリンキピア・マテマティカ』(Principia Mathematica) (1910-13) はケインズの確率論の体系化を可能にした数学的基礎であるともいわれている。ケインズの学生時代はラッセルの論理学の最盛期に当たり、1903年『数学の原理』(Principle of Mathematica) を書き終え、『プリンキピア・マテマティカ』の準備をはじめていた。ケインズが確率の公理体系を構成しようとしたのもその影響による。しかしケインズの論理学はラッセルの論理学と大きく異なるものである<sup>6)</sup>。

ラッセルは演繹的公理体系として形式論理学を形成したが、そこでの論証は論証的確実性 (demonstrative certain) をめざすものであり、 $a/h=1$  または  $0$  という特別な場合を扱い、経験とか日常的思考原理を除外していた。例えば、ラッセルの論理学は、含意の論理 (logic of implication) であるが、「 $p$  ならば  $q$ 」は  $p \vee q$  という選言命題と同義で、 $p, q$  の真偽 (1, 0) の値に命題の値がリンクする。この論理では、probability ではなく、truth を扱い、我々が日常「 $q$  は  $p$  から推論される」と意味することとは異なる。そこでケインズはより一般的な論理学、つまり演繹的論理学を特別なケースとして含みうる蓋然的領域を扱ういわゆる帰納的論理学を考える。つまり「含意と真偽の論理」から「蓋然性に基礎を置く合理的信念の論理」への拡張である。それは非決定的・非論証的論理をも包摂するものであり、真 (true) でも確実 (certain) でもないが、合理的 (reasonable) である日常の推論を正当化する理論であった。この現実的実践性という特徴は初期ケインズからのものである。

ケインズは確率を合理的信念の度合いにとらえ、また論理確率は人間の認識

により評価することであり、ケインズはムーアのこの直覚による判断も確率関係認識において継承し、認識論の基礎はまったくムーア的であった。

6) ケインズとラッセルの論理の違いは、詳しくは Callabelli (1989) Ch. 8 参照。ここではケインズ対ラッセルの対比が、相対的論理 (所与の条件、状況に制限される) vs 普遍的論理、実体的推論 (実体の意味理解重視) vs 形式的推論 (論理の規則は単に構文的規則に還元される)、実践的論理 vs 理想的論理、日常言語 vs 人工言語で示される。しかし Callabelli は「実践」を強調し過ぎ、ケインズが帰納推理の公理化つまり普遍化形式化をねらい、「理論」としての客観化への移行を目指していたことを軽視し過ぎている。

過程を扱っているので、前提  $h$  の情報量と質、確率  $a/h$  の論理的洞察力が個人間で異なるという主観的側面を当然もっている。その点では(4)の主観確率理論と混同されがちである。主観確率は、ベルヌーイ以来の期待効用仮説に厳密な証明を与える形で、ケインズ『確率論』の後、ラムゼー(Ramsey)、デフイネッテイ(de Finetti)により独立に提出され、フォン・ノイマン(von Neumann)、モルゲンシュタイン(Morgenstein)、サベッジ(L. J. Savage)により彫琢が加えられ、不確実性下の行動決定の基礎理論として、経済分析に適応されている。主観確率の特徴は以下の通りである。

- 1) 特定の命題に於ける特定の人の確信の度合を測定
- 2) 確率は行動、特に賭をする人の行動を調べることにより形成される
- 3) 客観的確率を否定
- 4) ある事象には1つだけの確率があるのではなく、各個人により違う
- 5) 合理的個人の確率は首尾一貫した(coherent) 確率計算により支配される。

この概念では確率は信念(感情)の強度であり、それは人々の特定の命題に対する行動により数値的に測定される。確率を数値に変換する典型的方法はラムゼーの賭理論である。主観確率における合理性とは、人々が一貫して(coherent) 確率計算をしなければならないという内の一貫性(internal consistency)であり、この広い意味の合理性の制限内で人々の選択は自由である。

合理的人間を抽象し、一組の前提を常に満たせば前提から導かれる確率計算は形式的・数学的確率として扱えるという意味では、合理性をもった主観の規範モデルとも言えるのであるが、個人は快樂主義的選好に基づき、それが数値的確率の基礎ともなる。したがって、快樂主義的、独我論的モデルである。これに対し論理確率は、主観の深淵に潜む法則性を見いだし、主観に内在する合理性を探るものである。それは、反省された人間に共通の主観といえる。その点で単なる個人的主観とは異なる。「確率関係は人間の気まぐれによって左右されるものではない。ある命題は、我々がそのように考えるから蓋然的なので

はない。知識を決める事実が一旦与えられるならば、それらの条件下で何が蓋然的 (probable) であるか、不可能 (improbable) であるかは、客観的に決ってしまう。それは我々の意見とは独立に決まるのである。」(TP p. 4)

O. Favereau (1988) の言うように、合理的論証の特徴は批判的精神の間に合意を得る能力があるところにあり、客観的確率とは合理的個人が論証を通じて求めるようなもの、つまり相互主観的に合理的=客観的であるところに合理性がある。さらに、主観確率は、「確率論」の中心問題である帰納法を「有用な精神的習慣」としか説明しえずなんら答を与えるものではない。このように、確率を頻度確率のように物理的世界の客観性に帰すのではなく、人間の主観性を扱いながらも主観確率と違い、その客観的構造をもとめたところに、ケインズ哲学の特徴がある。

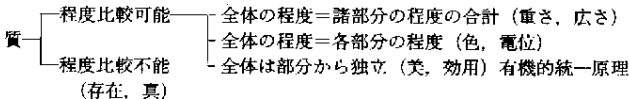
## II ケインズの不確実性

### 【確率論】における不確実性概念

次にケインズの不確実性概念を【確率論】から考察する。初期ケインズの関心の一つは質と量の関係であった。量的側面の異質性 (heterogeneity) を問題にしている<sup>7)</sup>。そして確率は共通の尺度で計ることのできる単一の数量の集合では必ずしもないと考える。確率は比較不能か可能か、比較可能な場合は基数的比較か序数的比較かによって3つに分類される。

7) 実践の場合には頻度概念も重要視せざるを得なくなることを認める。「多くの価値ある確率判断の多くは部分的には統計的頻度の知識に基づいている。幾分疑わしいとはいえ、より多くのものがそれらから直接的に引き出され得ると考えられる」(TP p. 117-118) ケインズは論理確率のフレームワーク内で頻度確率の役割を認め、頻度の知識を前提 h の中に含めることにより、確率判断の知識として考慮されるべきと考えている。

8) ケインズの初期の未出版の論文「Miscellanea Ethica 倫理学雑考」(1905)にもこの特徴がよく現れている。それは質と量についての概念と部分と全体についての概念を結合したものである。(O'Donnell (1989) p. 62 参照)





この比較の原理は以下の2つの直接的判断(直覚)に依っている<sup>9)</sup>。

1) 関係判断 (judgement of relevance)  $x/h$  と  $x/hh_1$  の比較。

つまり証拠は異なるが結論は同じ型の比較で新たなこれは新たな証拠  $h_1$  の付加が論証に関係するか、またどちらの方向へ関係するかを判断する。

2) 選好判断 (judgement of preference)  $x/h$  と  $y/h$  の比較。

つまり同じ証拠に対して異なった結論を比較する。

数値的確率が得られるのは選択肢の間に対称性があり、同程度に確からしいといえる時であり、それは、1)関係判断で関係する証拠がどの選択肢に関しても同じ形で、つまり1つの選択肢に関係する証拠がなく、2)選好判断で無差別となると、無差別原理が成立するといふ数値的確率が得られる<sup>10)</sup>。

非数値的確率の大小関係比較も選好判断と関係判断への還元からなる。確率を比較できるのは、(1)  $a/h$  と  $ab/h$  型、(2)  $a/hh_1$  と  $a/h$  型、(3) (1), (2)の型

9) 直覚判断は20世紀初頭ケンブリッジ合理主義の中心概念であり、事実についての真の存在を経験を超越して直接知ることができるとするアプリアリな総合判断を言う。ケインズは『確率論』において知識を直接えられるものと論証(argument)によるものとに二分し、直接的知識は3つの直接判断により形成される。感情による経験(experience)、意味の熟慮による理解(understanding)、知覚や観念の認識(perception)の3つである。論理関係認識もこの認識(perception)により直接的に得られるものであり、確率関係はこの直接的知識の基盤の上に論証(argument)により蓋然的知識として形成される。この直接判断に対してケインズは以下のように論評する。「諸確率間の等号不等号は、すべて直接判断にいくつかの点で依存している。このことはまったく避けられないことのように思える。しかし、それを弱点と見なすべきとは思えない。……重要なことは直覚に究極的に依存するという事実から、「我々の結論は理性の基盤を持たない」または「結論はその起源におけるのと同様に妥当性においても主観的である」と我々は仮定する必要はないことである」(TP p. 75-76)

10) 1) 関係判断において

$$\begin{array}{ll} x/h = x/hh_1 & \text{のとき } h_1 \text{ は無関係 (irrelevant)} \\ x/h < x/hh_1 & h_1 \text{ は有利に関係 (favourable relevant)} \\ x/h > x/hh_1 & h_1 \text{ は不利に関係 (unfavourable relevant),} \end{array}$$

2) 選好判断において

$$x/h = y/h \text{ のとき無差別 (indifferent)} \quad (TP \text{ p. } 58)$$

この無差別の原理は古典確率理論の不十分理由の原理をより正確にしたものである。無差別原理適用にはさらに2つの考慮が必要であるという。1)形式に関して:排反的で原子的(exhaustive)な一種の原子命題のみ適用可能。2)意味に関して:関係する証拠は命題の意味を含み意味の理解が付加的知識を与える。(TP p. 61)

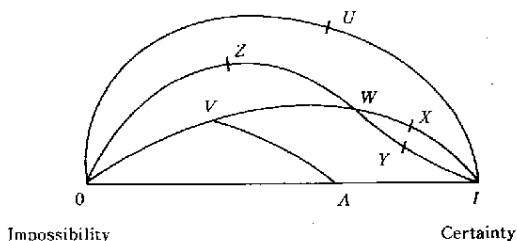
に無差別原理を結合した型のどれかに還元できる時のみで、それ以外の場合、確率の比較は不可能であろうとケインズは考える<sup>11)</sup>。

数値的確率は比較的狭い領域に制限されるのであり、以上の確率の関係をケインズは図2のように図示している。

図において各線は独立の序列化した確率系列であり（各系列は一般的に連続ではない）特徴は以下の通りに示される。1) 確率は同一の経路に乗っているときのみ比較できる（序数的比較）。2) 序数的比較は普遍化できない。（一般的に異なった経路との比較はできない。ただし交差するときのみ可能）3) 等しく確からしい（equi-probable）（図のO—A—Iの直線上）の時のみ、数値的確率が得られる。

「全ての確率の量的測定は可能」という原理に制限を加えることが『確率論』の主要な目的の1つである。これは、リスクと不確実性の区別と読むことができる。ナイト（F. N. Knight）は『Risk, Uncertainty, and Profit』（1921）

図2



確率の諸系列 (T. P. p. 42)

- 11) (1)型  $b/ah = 1$  でないならば  $ab/h < a/h$   
 (2)型  $h_1$  が  $a/h$  に favourable ならば  $a/hh_1 > a/h$   
 $h_1$  が  $a/h$  に unfavourable ならば  $a/hh_1 < a/h$   
 (3)型  $a/hh_1 > a/hh_2$ ,  $a/h = b/h$ ,  $b/h > b/hh_1$  が所与の時  $a/hh_1 > b/hh_1$  を得る。  
 (2)型はとも広く様々なケースをカバーする。個人の直接的関係判断に過度に依存するのを避けるために、(2)型に含まれている新しくより特別な原理を見つけなければならない。それらの内の2つアナロジーと帰納法は特に重要であるとして、TP Part 3 で研究されることになる。

(TP p. 71-73)

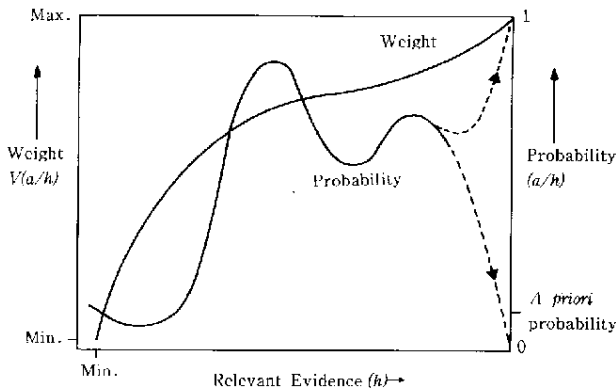
において、確率分布がわかり数値的確率が得られるのをリスク、得られないのを不確実性としたが、ナイトの不確実性概念の区別の歴史的優先性は疑問視される<sup>12)</sup>。以上の議論は非数値的であれ、比較不能であれ、確率自体は既知 (known) であった。しかしケインズは確率関係が人間の直覚能力の限界により未知 (unknown) となる未知の確率 (unknown probability) の存在も認めている。このことは非数値的確率に続いてケインズの確率の2つめの特徴と言える。これは漠然とした知識 (vague knowledge) としてケインズにより分類されている。しかし、その分析は、難しい問題をより複雑にするとして扱われない。「確率論」ではあくまで明確な知識 (distinct knowledge) の分析に重点が置かれ、合理的判断の必要条件が分析されるのである。しかし、その限界として漠然とした知識の広大な領域が認められてくるのは避けられない。つまり、合理的判断がなされ得るのは、非常に限られた場合においてのみなのである。

次に、「一般理論」で扱われる不確実性概念を問うとき重視される、「確率論」におけるウエイト (weight of arguement) を見ておく。ケインズはウエイトも確率同様に定義しないが、関係する  $h$  の増加と共に増す「確率の信頼性」を指すのがウエイトと思われる。つまり、関係する新しい情報は、確率を増加させるか、減少させるか分からないが、常にウエイトを増加させる。その相関関係は図3のように示される。またウエイトの特徴は以下の様にまとめられる。

- 1) ウエイトは関係する証拠 (relevant evidence) の量に関係する。確率は関係する証拠の (favourable-unfavourable) のバランス、差異を測定するのに対し、ウエイトは関係する証拠の全体量を測定する。(TP p. 77, 82)
- 2) ウエイトは確率とは独立。ウエイトを  $V(a/h)$  と表すが、 $a/h$  の関数ではない。ウエイトが増加しても必ずしも確率は増加しない。(TP p. 82)

12) 例えば以下のように言っている。「実際に保険業者自身はその確率が比較的狭い数値的極限の間にあるか、または全ての可能性をカバーする「賭け」が可能であるかの理由により、適切に保険がつけられるリスクと、このようには扱えず、一般的保険業務の基礎を形成できない別のリスクを区別している。」(TP p. 25)

図3



ウエイトと確率の相互作用 (O'Donnell (1989) p.72)

しかし、ウエイトは論証の証明または反証への近さ (nearness to proof or disproof) に関係する。ケインズはウエイトの最大化分析を行わないが、確率が1または0の時ウエイトは最高になるであろう。

- 3) ウエイトもまた必ずしも数値で表せるとは限らないが、確率の3つの比較原理に対応してウエイトの比較が考えられる<sup>13)</sup>。

#### 『一般理論』における不確実性

次に、『一般理論』で扱われる不確実性を考察する。『確率論』における「確率—ウエイト」概念が、そこでは「期待—確信」概念として扱われる。

- 13) 1) 無差別原理が適用できるとき、等しいウエイトを持つ  
 $a/h = b/h$  のとき  $V(a/h) = V(b/h)$   
 2)  $h_1$  が relevant ならば  $V(a/hh_1) > V(a/h)$   
 $h_1$  が irrelevant ならば  $V(a/hh_1) = V(a/h)$

規則は  $ab/h$  と  $a/h$ ,  $a/h_1$  と  $a/h$ ,  $a/h_1$  と  $b/h_1$  の比較をカバーするまでは進められない。例えば、 $ab/h < a/h$  のとき  $V(ab/h) < V(a/h)$  (所与の命題に対しより複雑な結論はそのウエイトが低い) と思えるかもしれないが、それは不当である。 $ab/h$  は  $a/h$  より証明にはより遠い (further off proof) だが反証にはより近い、という特徴 2) 3) の理由を上げる。(TP p. 78-79) ウエイトは、実践的には意味を理解できるが、理論的には不十分な概念である。

O'Donnell (1990) で述べられているように、ケインズは2つのレベルで不確実性を分析した。1つは決定論的レベル(短期期待の場合)、もう1つは非決定論的レベル(長期期待の場合)である。

ケインズは期待を短期期待と長期期待に識別した。短期期待は、既存の資本設備から生産を決意するに当たって、完成財の予想収益の推定であり、将来の変化を予想して修正されるよりも、結果に照らして短期間で修正される。環境の大部分は実質的に日ごとに変わる事なく存在するので、短期の決意が結果と期待を区別しなくてもよい。すなわち、ほぼ実現し安定的なもの、確率計算が可能なものとみることができる。また推論の前提を構成する情報  $h$  も比較的十分得られるであろうから、ウエイトも高いであろう。一方、長期期待は新しい資本設備投資を決意するに当たってその結果として得られる予想収益の推定であり、つまり、多かれ少なかれ確信をもって予測しうるに過ぎない将来の出来事(資本資産ストックの類型や数量の将来の変化、消費者の嗜好の将来の変化、その投資物件の存続期間における時々の有効需要の強さ、存在期間に起こるかも知れない貨幣表示の賃金単位の変化)を推定することであり、そこでは確率関係の認識が非常に困難になる。従って、期待形成においてはウエイトの側面の重要性が増す。「我々の決意の基礎を成す長期期待の状態は単に我々の行うことのできる最も蓋善性の高い予測にのみ依存するのではない。それは同時にその予測をするに当たっての確信に——我々の最善の予測が全く誤りに期する可能性を我々がどの程度高く評価するか——依存する。もし大きな変化を予測しながらもこれらの変化がどのような明確な形態をとるかについてきわめて不確実であるならば、我々の確信は弱いものであろう」(GT p. 148 訳 p. 146) また、この長期期待における顕著な事実は、「我々の知識の基礎がほとんどないか時には全く無である」(GT p. 150 訳 p. 148) ことにある。ケインズは脚注で「極めて不確実 (very uncertain) ということは極めて蓋然性が低い (very improbable) と同じことを意味しない。」(GT p. 147 訳 p. 146) という。つまり不確実性は確率だけでなく、確率の信頼性はあるかというウエイトが大きく

関係し、長期期待における不確実性は、そもそも知識の基礎  $h$  が少ないこと、すなわちウエイトが低いことに特長がある。従って、高い確率でもその信頼性であるウエイトが低いとき不確実ということもありえるのである。

1937年の論文「雇用の一般理論」で、彼は再度不確実性概念を強調して以下のように書いている。「不確実な知識 (uncertain knowledge) とは、たんに蓋善的 (probable) なものから確実 (certain) なものと知られているものを区別するのではない。……なんらかの確率を形成することができる科学的な基礎は何もない。単に我々は知らないだけである。」(CW 14 p. 113-4) このように不確実性は、確率自体が知られないことから生じることも当然ある。確率自体が知られない未知の確率 (unknown probability) 領域の不確実性である。これは、新古典派が不確実性を認識できなかったことに対するラディカルな批判である。

しかし確率が既知であったとしても、ランキングして比較できないという意味での不確実性も存在し得る。「一般的に言って、決意をなす際、我々の前には多くの選択肢があり、各々の完全な帰結から得られる利益の集計を価値にしたがって配列可能という意味においては、外のものより、より「合理的」と論証できるものは1つも無い。したがって Buridan's Ass となることを避けるためには、別の種類の動機、それらは帰結を評価することに関係しているという意味で「合理的」なのではないが、習慣、本能、選好、欲望、意志などによって決定される別の動機に頼るのである」(CW XXIX p. 294)。

このように経済学における「不確実性」概念は、「確率論」の論理確率の概念から導出されたと言える。そして、長期期待においてアプリアリに決定論的に述べ得ない不確実性が存在するとの認識が、ケインズに短期理論という形式を取らせたと言える。

### III ケインズの合理性概念

「確率論」はムーアに於ける規則主義への批判、ベンサム主義への批判とい

う両面批判として書かれたものである。ここで規則主義とは、ムーアが『倫理学原理』第5章「倫理学の行為に対する関係」において、個人がいかに行動すべきかを問題とする時、「一般的に有用であるとともに一般的に実行されている規則」があるときは、常にその規則に従うべき。とする行動原理をそれは指す。ケインズは「ムーアの道徳を捨てた」(CW X p. 434 訳 p. 569) と言い、既成道徳を尊重しながらも、それに絶対的に服従するのではなく、道徳によらずとも何が正しく、何が誤っているか判断できる権利、個人の能力を主張した<sup>14)</sup>。また、ここでベンサム主義とは、ムーアが理想主義的功利主義により快楽主義を否定したが、依然として、誤った確率概念=頻度確率に立脚している事を指す。それは、善、確率の数値的可測性、加算性を前提に結果の数学的期待値極大化を行動原理とする、いわゆる新古典派の合理的経済人が依拠する功利主義的行動仮説である。『確率論』はこのように、規則主義、ベンサム主義の両面批判となっている。

『確率論』第26章「行為への確率の適用」において、合理的行為の理論が述べられている。ベンサム主義については、ケインズは既に述べたように、論理確率の見地から、1) 善 (=価値) は本質的に数値に還元不能、2) 確率は本質的に数値に還元不能、3) 論証の重みを考慮していない、4) モラルリスク<sup>15)</sup>を考慮していない、という4点から批判を加える。数値的期待値が存在しないことから、ケインズは確率と善を一緒とした全体的状態を直覚により評価する方法を取るが、善の量:  $A > B$ , 確率:  $A < B$ の時など直覚による判断が常に可能とは言っていない。そのようなとき、合理的人間はどうすべきかという事について『確率論』は問題にしない。同様に(高いウエイト高いリスク)(低いウエ

14) 『若き日の信条』において、ケインズがムーアの道徳に何の関心も払わなかったという記述は多くの論争を引き起こした。ここでの解釈は、初期ケインズの未出版論文をも含めた O'Donnell (1989) (p. 148~p. 154)の分析による。

15) モラルリスクとは A: 結果の善の量  $p$ : その確率  $E: E = pA$  となる数学的期待値,  $R$ : モラルリスク,  $q = 1 - p$  とすると,  $R = p(A - E) = p(1 - p)A = p(A - qE)$  リスクとは  $E$  (直接的犠牲) に  $q$  (無駄になる確率) をかけたもので期待損失の概念と言えらる。  $p, q, A$  が数値的なときリスクも数値的であるが、非数値的ならば、リスクの大きさは直覚によってのみ接近しうるとされる。

イト低いリスク)の比較の問題も困難を生じる。このように、人間の理性に限界が存在することから、ベンサム主義の極端な理性の過信を批判すると共に理性だけでなく経験も考慮することが強調される。そして、論理能力、経験(情報量)という2つの意味で、帰結の蓋然性は我々に対して相対的なのである。ケインズにおける行為の合理性は、ウエイトとモラルリスクに注意を払いながら、推論と言っても究極的には直覚に基づいて、帰結の蓋然的善を最大化すると判断される選択肢を選択する行為であり、ケインズも蓋然的形態としての行為帰結主義といえる。このとき、信念における合理性は論理的かつ経験的基礎に基づく<sup>16)</sup>。

新古典派経済学において経済学とはロビンス(L. Robbins)の有名な定義にあるように「目的と代替的用途を持つ希少な手段との間の人間行為を確立する科学」である。新古典派の行為の合理性はこの「目的—手段」関係の合理性であり、選択の問題は経済外から所与とされた目的に対し、いわゆるベンサム主義の数学的期待値極大化により最適な手段を機械的に解く数学的問題に還元される。そのため完全知識と計算能力が合理的主体に仮定される。このような方法論はケインズが『確率論』で批判した擬似合理的方法であり、現実的には最も論理的合理的な人間でも示せない選択判断である。新古典派経済学がベンサム主義の仮定の上に立つというのがケインズの持論であり、『確率論』の合理的行為理論の基本認識は後の経済学において新古典派経済学の方法論的個人主義批判へ連続して行くのである。

#### 経済学における不確実性下の合理性

次に、『一般理論』に示される経済主体の合理性を考察する。ケインズは資本主義制度下の経済主体とその行動型を2つに識別した。1つは、企業家(投

16) 同じ人間の理性の限界を認めるといってもオーストリアンの合理性とは異なる。彼らは手段の選択は客観的だが、目的の選択は主観的であり、その客観性は考えない。また経験の要素はケインズほど明示されない。



資家)で「資産の全存在期間に渡る予想収益を予測する活動」(GT p. 158 訳 p. 156)を行い、もう1つは投機家で「市場の心理を予測する活動」(GT p. 152 訳 p. 150)を行う。その区分にともなってそれぞれの合理的行動とは、企業家は投資の収益という実状に即した知識の要素から評価することであるが、長期における真正な確率計算ができないことから、自生的な楽観や血気(不活動よりもむしろ活動を欲する自生的衝動)に頼ることになる。投機家は平均的意見は何が平均的になるかと予想しているかと予測することにより、大衆に先んじる判断が合理的行動となるが、それは多数の無知な個人の群衆心理の産物として生まれた慣習的評価に基づく。また両者とも変化を予想する特別の理由がない限り、現在の事態が無限に持続すると想定する。という時間的意味の慣習的判断にも依存する。1937年「雇用的一般理論」で合理的経済人の体面を保つにはとケインズがあげているのは、次の3つである。1)何も知らない将来の見込みを無視し、現在の状態が続くと仮定。(時間的意味での慣習的判断) 2)価格に表現されたものとして現在の意見と算出の性質は将来の正しい評価に基づくと仮定。(集計的表現と社会的現実の類似性を仮定) 3)行為を大多数や平均意見に一致させる。(空間的意味での慣習的判断) ここで個人の行動の合理性は、社会に示されている意見により制約される。個人の行動が不確定であっても、個人の行動に影響を及ぼす社会的心理の影響を重視し、社会的平均意見である慣習的判断に個人が依存することにおいて、ケインズの個人は社会に規定されている。

『確率論』では、ごく狭い領域において論理的合理性の分析がされた。「一般理論」では、その領域からはみ出た範囲での合理性分析がなされる。そこでは、主観的、心理的アプローチがなされる。ケインズは慣習的判断やアニマルスピリットをも現実的選択においては合理的行動とみるのであり、それを非合理として排除する新古典派より、より広い合理性概念を経済学に持ち込んでいる。これは、サイモン(H. Simon)の言葉で言えば bounded rationality, procedural rationality に相当する。この意味で、前期—後期ケインズの合理性概

念は変化していると言える。つまり、経済人は、純合理的ではない。論理的推論以外により得られる現実的合理性に依存している。しかしこのことは次のようにも言える。つまり、『確率論』は日常の推論を研究すると言っても、あくまでも開化された人、エリートの論理であったのに対し、経済学においては、大衆の合理性が分析に入り込み、分析対象の変化、分析範囲の広範化と言える。ケインズ自身の合理性の哲学は、あえて二分化して、前期—後期連続的であると考えたい。それはケインズが『若き日の信条』で「私は依然としてインモラリストである」(CW X p. 447 訳 p. 582) つまり自己の判断能力を信じていたように、エリート、政策立案者として、客観的マクロ理論を作ったことにそれがある。限定された理性という同じ認識に立ちながら、オーストリアンのように主観的、原子論的モデルを取るのではなく、方法論的個人主義を越えたところに客観的マクロ理論の集計量間の理論を作った事は、独我論的、快楽主義的主観理論でなく、客観性をもつ論理確率理論を取ったケインズの確率に対する態度と共通する。

#### 終 わ り に

『確率論』における認識論の哲学のうえで、ベンサム主義的合理的選択は、どんなに論理能力が強くても示せぬとした批判は、経済学における不確実性の認識に、そしてその下での合理的経済人の行動に、新古典派の想定するものとは顕著な違いを露呈した。前期と後期では、合理性概念の対象と範囲が変化しているが、ケインズ自身の基本的哲学的枠組みは変化しないと考えている。そのことを論じるには、ケインズ経済学方法論に立ち入らねばならないが、稿を改めて論じたい。また本稿では、従来論争となっていた『若き日の信条』の解釈、ラムゼイ批判も含めて、ケインズ哲学の前期—後期の整合性の問題論じなかったが、これも別の機会に譲りたい。

## 参考文献

- T. Lawson & H. Pesaran (ed) (1985) *Keynes Economics: Methodological Issues*, Routledge.
- Carabelli, A. M. (1988) *On Keynes Method*, Macmillan.
- A. Fitzgibbons (1988) *Keynes's Vision*, Clarendon Press.
- O'Donnell (1989) *Keynes: Philosophy, Economics and Politics*, Macmillan.
- B. Bateman & J. Davis (ed) (1990) *Keynes and Philosophy*, Edward Elgar.
- O'Donnell (ed) (1991) *Keynes as Philosopher-Economist*, Macmillan.
- B. Gerrard & J. Hillard (ed) (1992) *The Philosophy and Economics of J. M. Keynes*, Edward Elgar.
- J. M. Keynes *The Collected Writings of John Maynard Keynes*, Macmillan.
- 以下 CW と略記
- CW VI (1936) The General Theory of Employment, Interest and Money.
- CW VII (1921) Treatise on Probability, reprinted in 1973.
- CW X (1972) Essays in Biography.
- CW XIV (1973) The General Theory and After: Part II Defence and Development.
- CW XIX (1979) The General Theory and After: a supplement
- (1937) 'The General Theory of Employment', *Quarterly journal of Economics*, in CW XIV.
- (1949) 'My Early Beliefs' in CW X.
- Favereau, O. (1988) 'Probability nad certainty: after all, Keynes was right', *Economic*, no. 10.
- Harrod, R. F. (1951) *The Life of John Maynard Keynes*, Macmillan.
- 〔ケインズ伝〕塩野谷 (訳), 東洋経済新報
- 菱山 泉 (1967a) 「ケインズにおける不確定性の論理」思想, 4月号
- (1967b) 「ケインズの投資理論における「経済人」」思想, 9月号
- (1968) 「ケインズの貨幣と不確定性の論理」思想, 4月号
- (1990) 【ケネーからスラッファへ】名古屋大学出版会
- 伊藤陽一 (1965) 「確率に関する諸見解について」統計学, 14号, 3月
- (1966) 「ケインズの確率論について」統計学, 16号, 10月
- 北川敏男 (1948) 『統計学の認識』白楊社
- Knight, F. H. (1921) Risk, Uncertainty and Profit, in LSE Scarce Tracts, no. 16.
- Moore, G. E. (1903) *Principia Ethica*, Cambridge University Press.

- 【倫理学原理】深沢 (訳), 三和書房.
- R. M. O'Donnell (1990) 'Keynes's Weight of Argument and its Bearing on Rationality and Uncertainty' in Bateman (1990).
- 佐藤隆三 (1970) 「『確率論』とケインズの経済学の方法」『ケインズ—般理論研究』小泉, 筑摩書房
- 塩沢由典 (1983) 「『確率論』からみたケインズ」経済セミナー『ケインズ生誕100年』
- Skidelsky, R. (1983) *John Maynard Keynes vol. 1 Hopes Betrayed*, Macmillan.  
【ジョン・メイナード・ケインズ(1) 裏切られた期待 1883-1920】宮崎 (監訳) 古屋 (訳), 東洋経済新報
- Shackle, G. L. S. (1949) *Expectation in Economics*, Cambridge University Press.
- 山田雄三 (1950) 「ケインズの『確率論』について——覚書——」  
【ケインズ経済学研究】ケインズ研究会編, 春秋社