

Методология. ЕЩЕ РАЗ О РЕВОЛЮЦИИ ДЖ. М. КЕЙНСА (ОПЫТ ПОСТРОЕНИЯ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКОЙ ТЕОРИИ ДЛЯ ЭКОНОМИКИ С НЕОПРЕДЕЛЕННОСТЬЮ)

Автор: Н. А. МАКАШЕВА

Кейнсианская революция в историческом контексте

Кейнсианская революция - одно из ярчайших явлений экономической мысли не только XX в., но и всей ее истории. Независимо от того, как мы трактуем "революцию в экономической науке", и вообще уместен ли термин "революция" применительно к ее истории, вряд ли кто-либо будет оспаривать утверждение, что Дж. М. Кейнс был революционером, если под этим понимать человека, способного понять новое и отстаивать это понимание в различных областях. И хотя такой выдающийся мыслитель и постоянный оппонент Кейнса, как Ф. Хайек, полагал, что будущим историкам нелегко будет объяснить столь большое влияние кейнсианских идей на целые поколения [Науек, 1983], пока это сделать не так трудно.

Кейнс обладал смелостью и решительностью, чтобы выступить против экономической мудрости предшествовавших поколений, устоявшихся моральных норм и принципов в политике в период, когда крах старых идей и убеждений стал очевиден. Он критиковал не только господствующие в экономической науке представления, но и принципы политики своего правительства, поставил под сомнение многие ценности, которые, казалось, и обеспечили экономическое и политическое лидерство Англии в XX в., предложил свое понимание того, что можно назвать партнерскими отношениями между властью и обществом. Как ученый он, по словам Й. Шумпетера, стремился переложить новое видение реальности на язык экономической теории [Shumpeter, 1997, p. 268]. Благодаря Кейнсу экономическая наука заняла исключительное место среди общественных наук как реально влияющая на экономическую действительность. Более того, если во времена Кейнса, как он сам писал, политики пытались представить себя не зависимыми от научных влияний, то сегодня хорошим тоном считается ссылка на научные авторитеты, хотя, разумеется, это не означает готовности политиков строго следовать их рекомендациям.

Что касается термина "революция" в более строгом, науковедческом смысле, то несмотря на сложившуюся традицию, остается вопрос о том, насколько правомерно использовать этот термин применительно к теории Кейнса и в целом в экономической науке. Но если не очень беспокоиться относительно строгости использования терминов, то вряд ли можно поставить под сомнение революционность того, что было им сде-

Макашева Наталья Андреевна - доктор экономических наук, профессор Государственного университета - Высшей школы экономики, заведующая отделом экономики Института научной информации по общественным наукам РАН.

лано. Во всяком случае, впечатляет быстрота, с какой идеи Кейнса завоевали признание как большей части научного сообщества, так и широкой публики и политиков. Вспомним, что даже такому бесспорному революционеру, как И. Ньютон, пришлось ждать несколько десятилетий, пока в 1758 г. выводы его теории подтвердило возвращение кометы Галлея, предсказанное на основании законов гравитации. Что же касается экономической науки, то здесь ситуация менее ясная. Так, несмотря на практически одновременное появление основополагающих работ Л. Вальраса, У. Джевонса и К. Менгера, трудно говорить о маржиналистской революции как о скоротечном событии: потребовалось не одно десятилетие, прежде чем идеи перечисленных авторов завоевали признание профессионального сообщества, не говоря уже о более широких кругах.

О победе Кейнса в профессиональной сфере можно было говорить уже в 1949 г., когда его идеи вошли в учебный процесс благодаря "Вводному курсу" П. Самуэльсона [Самуэльсон, 1964; Samuelson, 1948]. Более того, уже в 1939 г. Самуэльсон предложил свою знаменитую сорокапятипроцентную схему для определения равновесия с неполной занятостью [Samuelson, 1939, p. 75 - 78]. В области же политики, как ни парадоксально это может показаться, кейнсианская революция произошла даже раньше, чем появилась "Общая теория занятости, процента и денег". Еще в начале 1930-х гг. Кейнс принимал активное участие в обсуждении американских проблем с вдохновителями Нового курса (например, с Ф. Франкфуртером), он общался с президентом Ф. Рузвельтом и подчеркивал исключительное значение американского эксперимента как указание на способ преодоления косности мышления и опасного сползания к хаосу [Keynes, v. XXI, p. 289].

Хотя в Англии поворот к новой стратегии экономической политики начался позже и среди политиков было много разногласий, он осуществился достаточно быстро. Об этом свидетельствуют, например, бюджеты 1941 и 1942 гг., которые в полной мере отражали кейнсианские установки, не говоря уже о знаменитом докладе У. Бевириджа 1942 г., в котором достижение полной занятости провозглашалось настолько приоритетной целью, что ради ее достижения признавалось возможным даже отойти от принципа неприкосновенности частной собственности на средства производства - радикализм, более сильный, чем у самого Кейнса. Наконец, принятие "Full Employment Act" 1946 г. в США стало законодательным оформлением кейнсианских идей регулирования.

Быстрое продвижение вовсе не означает, что победа была легкой. Причем в науке она достигалась труднее, чем в практической области. Публику и отчасти политиков, как правило, больше захватывает риторика, чем строгая логика научного дискурса. И в данном случае восприимчивость объяснялась как реальной ситуацией в экономике, так и тем, что в обществе еще в конце XX в. стало складываться убеждение в социальной ответственности власти.

Существенным фактом, облегчившим победу Кейнса как социального реформатора, стал и общий прогресс научного знания. Конечно, главная заслуга здесь принадлежала естественным наукам: их впечатляющие успехи породили веру в возможности человеческого разума лучшим образом обустроить физический мир. Многие верили и в то, что общественная наука обеспечивает базис для решения социальных проблем так же, как науки естественные для решения проблем технических¹.

Когда заходит речь о преобразованиях, неизбежно возникает вопрос о субъекте. И в конце XIX в. на эту роль вместо поблекшей аристократии или клерикальных кругов стали претендовать интеллектуалы. Знаменательно, что на рубеже веков Т. Веблен и Дж. Р. Коммонс писали о новой общественной силе - научной и управленческой элите, то есть о профессионалах, которым суждено было в будущем потеснить образованных, часто широко образованных, любителей в сфере политики и экономики. Сам Кейнс по существу и был одним из первых профессиональных *adviser* от науки.

¹ Замечу, что даже распространение социалистических идей с характерным для них креном в социальный конструктивизм в конечном счете было связано с общей тенденцией повышения роли научного знания как некоей реальной силы при решении практических проблем.

Что касается революции в области теории, то она также началась до "Общей теории", последняя в какой-то степени стала развитием и обобщением, хотя и далеко не строго оформленным и завершенным, идей, высказанных ранее, а также переложением на язык экономической теории предложений, уже сделанных в области практики. "Общая теория" преследовала цель не убедить политиков (это уже состоялось), а завоевать признание профессионального сообщества. Не случайно в предисловии к этой работе Кейнс писал, что его работа адресована коллегам-экономистам, посвящена **сложным теоретическим вопросам и только во вторую очередь их практической значимости**. Предвидя, что одни экономисты будут утверждать, что в "Общей теории" он не сказал ничего нового, а другие - что он совершенно не прав, Кейнс считал необходимым прежде всего убедить коллег-экономистов, а не публику. При этом он понимал, что сложнее **освободиться от старых идей, на которых он и экономисты его поколения были воспитаны и которые проникли в "самые отдаленные уголки сознания"**, чем даже **понять новые** [Keynes, 1936, p. V-VI] (ссылка дается на английское издание, поскольку в русских переводах предисловие Кейнса по непонятным причинам оказалось опущенным).

Он атаковал "классиков" за их неадекватные предпосылки, за принципиальное непонимание ограниченности их теории, связанной с невниманием к институциональным моментам, но, быть может, самое главное - с **игнорированием неопределенности как важнейшей характеристики реального мира и одновременно следствия ограниченности нашего знания**. Осмысление феномена **неопределенности** - одно из основных направлений философских и экономических изысканий Кейнса, которое отошло на задний план перед лицом тех простых рекомендаций, к которым свелась "кейнсианская мудрость".

Основные моменты кейнсианской исследовательской программы настолько хорошо известны, что их можно лишь обозначить: сдвиг от микро- к макроподходу, от длинного периода к короткому, от реального к **денежному анализу**, от изменения цен к изменениям количеств; признание устойчивости потребительской функции и функции сбережений и неустойчивости функции инвестиций и спроса на деньги из-за влияния на поведение субъектов **фактора неопределенности**, разграничение между субъектами решений о сбережении и инвестировании; представление о проценте как о денежном факторе (определяемом предпочтением ликвидности); признание того, что реальная заработная плата устанавливается исходя из уровня дохода, а не наоборот, что предложение рабочей силы зависит от номинальной заработной платы, а предельная тягость труда, как правило, ниже существующей на рынке реальной заработной платы. Все эти новшества в аналитическом аппарате и позволили Кейнсу показать возможность существования равновесия при неполной занятости. **Смысл утверждения, что неполная занятость может не означать неравновесной ситуации, состоит в том, что в рамках практически значимого периода времени из этого положения невозможно выйти обычными "ценовыми" способами, которыми располагает рыночный механизм.**

Как нередко бывает, к основной идее примешиваются менее существенные, привлекающие неоправданно большое внимание как ее сторонников, так и противников. В данном случае речь идет, во-первых, о распространенном убеждении, что выводы Кейнса определены недостаточной подвижностью заработной платы, а во-вторых, о некотором флере социалистических идей, который, справедливо или нет, окрашивает кейнсианство. Что касается первого, то оно вызвано не чем иным, как стремлением представить теорию Кейнса частным случаем классической теории и в связи с этим нежеланием признавать, что существующий в реальной действительности факт относительной негибкости заработной платы хотя и увеличивает вероятность равновесия с неполной занятостью и масштабы последней, вовсе не является его необходимым условием. Что же касается второго обстоятельства, то некоторое основание для возникновения подобных представлений дает тот факт, что на величину мультипликатора влияет распределение дохода, а именно: в результате перераспределения доходов в пользу ме-

нее обеспеченных граждан, величина мультипликатора увеличивается, в том же направлении действуют и государственные расходы, финансируемые за счет налогов².

В результате вся концепция Кейнса приобрела некоторую "левую окраску", что только придало ей популярности, по крайней мере в глазах многих интеллектуалов того периода. Получалось, что Кейнс своей работой дал теоретическое обоснование и оправдание идее перераспределения доходов и роста государственных расходов. Но следует подчеркнуть: независимо от того, соглашаться или нет с подобными представлениями, нельзя упускать из вида, что у самого Кейнса речь шла не о социальных мерах, отвечающих представлениям о справедливости, но о предложениях, вытекающих из теории и, кроме того, отвечающих интересам всех групп населения, а не только наименее обеспеченных.

Привлекательность идей Кейнса для многих, прежде всего молодых экономистов, вовсе не означала отсутствия оппозиции в кругах профессионалов-теоретиков. Эта оппозиция была представлена так называемыми структуралистами (А. Пигу, Э. Кэннен, Г. Клей), которые связывали безработицу с завышенной реальной заработной платой особенно в стагнирующих отраслях, и сторонниками австрийской школы, традиционно делающих упор на функционировании механизма цен и соотношении межвременных предпочтений людей и уровней процентных ставок, определяемых в банковской сфере. Напомню, что в тот период австрийцы отстаивали денежную теорию цикла, которая связывала кризис и безработицу с чрезмерными инвестициями [Hayek, 1931; Robbins, 1934]).

Кейнс атаковал своих теоретических противников, избрав мишенью "Теорию безработицы" А. Пигу [Pigou, 1933]³. Но эта критика не была, строго говоря, критикой на одном и том же поле: по существу, речь шла о различиях не только и даже не столько в теории, сколько в методологии, не говоря уже о различиях более широкого плана. Кейнс в "Общей теории" отказался от ранее использованного им же самим и большинством экономистов подхода - рассматривать последовательность периодов. Он предложил, по сути, статическую модель, в которой все происходящее относилось к одному периоду. Но именно этот подход, как ни странно, и явился шагом к динамике. И здесь мы сталкиваемся с одним из парадоксов Кейнса.

Хотя я сделала оговорку, что говорю о революции Кейнса не в строгом смысле, тем не менее трудно игнорировать требование И. Лакатоша, согласно которому прогрессивная исследовательская программа должна превосходить своих конкурентов по объясняющей способности: объяснять все то, что объясняет конкурирующая, а также "новые факты" - те, которые не были известны в момент создания этой программы. В случае с Кейнсом таких фактов как будто бы и не было. Безработица была хорошо известным фактом и, более того, логически строго объяснимым в рамках старой программы: в качестве причины безработицы назывались различного рода "жесткости", включая завышенную реальную заработную плату, монопольные цены, тарифы, завышенный валютный курс и т.д. Однако эту приятную для классики ситуацию несколько портили свидетельства аномального с ее точки зрения поведения реальной заработной платы и безработицы. Так, в США с 1929 по 1933 г. реальная заработная плата падала при увеличении безработицы. В Англии ситуация была иная - номинальная заработная плата постоянна, реальная увеличивалась, росла и безработица.

² Это является следствием реалистичного предположения, что богатые относительно больше сберегают, чем бедные, то есть их мультипликатор меньше мультипликатора бедных.

³ Замечу, что хотя Пигу и был выбран мишенью критики, в "Теории безработицы" можно найти немало общего с "Общей теорией" (например, зависимость занятости от агрегированного спроса). Если оставаться в рамках простой макроэкономической модели, то расхождения будут связаны с представлениями о функционировании рынка труда, что, разумеется, очень важно, как отмечал и сам Кейнс, но не исчерпывает различий в теоретико-методологической позиции, и в частности в том, что касается фактора неопределенности.

Новаторство Кейнса связано в данном случае с введением нового **понятия** - вынужденной безработицы и его проецированием на реальную действительность⁴. И это новое понятие позволяло увидеть явление, которое старая исследовательская программа попросту игнорировала. Насколько строгим было определение вынужденной безработицы - как объекта теоретического рассмотрения - и насколько убедительным объяснение этого феномена - вот ключевой вопрос. Кейнс предложил объяснение, которое выглядит достаточно правдоподобным и согласующимся с обыденными представлениями. При этом, определяя вынужденную безработицу, Кейнс сразу же связывал ее с ситуацией в экономике в целом, а не только на рынке рабочей силы, и тем самым уже противопоставил себя классикам. И здесь, как мне кажется, и кроется суть "макроэкономизма", лучше сказать - холизма Кейнса, а совсем не в простом оперировании агрегированными показателями.

Вклад Кейнса в развитие науки, полагаю, состоял не столько в предложении законченной системы, сколько в демонстрации того, насколько важно уметь отказываться от устаревшего. Его система является открытой в том смысле, что она представляет собой не строго логическую конструкцию, построенную на базе исходных предпосылок, а достаточно эклектическую совокупность утверждений, допускающую не только различные подходы к анализу различных проблем, но и изменение их трактовки.

Далеко не бесспорным, но, полагаю, возможным становится соотнесение того, что пытался сделать Кейнс, с процессами, происходящими в науке на рубеже XIX-XX вв., а именно - отказом от науки классического типа с ее **стремлением к поиску единой и универсальной и детерминистской картины мира**. Иными словами, речь идет о разрыве с механистическим универсализмом (у Кейнса этот разрыв наиболее явно проявится в представлении о природе и свойствах денег⁵) и обращении к менее законченной, но более открытой системе. Конечно, лидирующая роль в этом процессе трансформации науки принадлежала физике: открытия в области квантовой физики подорвали незыблемость классической картины мира. Ирония состояла, однако, в том, что в то время, когда физики осознали узость классической науки, представители многих других наук только "освоили" классическую физику и видели в ней образцовую систему научного знания.

Что касается экономической науки, то идея строгой универсальной схемы, которая не была чужда экономистам-классикам, но все-таки в их работах не исключала возможности исторического и социологического подходов, получила в последние десятилетия XIX в. в работах маржиналистов, и прежде всего Вальраса, законченное воплощение. Однако одновременно с поисками универсальной теории наблюдалась активизация эмпирических исследований. Важные изменения произошли и в институциональной структуре экономической науки: в частности, начала складываться современная система сбора статистических данных, без чего невозможно было бы выполнение экономической наукой практических функций, формировались национальные профессиональные сообщества экономистов, начали выходить профессиональные научные экономические журналы, некоторые из которых существуют до сих пор.

Важным моментом в развитии науки того периода был общий интерес к области субъективного и усиление внимания к психологии. В каком-то смысле эта тенденция была реакцией на материализм предшествовавшей эпохи. Наиболее ярким примером здесь, конечно, был З. Фрейд, влияние которого выходило за пределы той области, в которой он непосредственно работал. Экономическая наука отдала должное субъективизму: появление субъективной теории ценности может рассматриваться как явление этого порядка. Однако, хотя теория субъективной ценности явилась исходным пунктом

⁴ Согласно Кейнсу, "люди становятся вынужденно безработными, если при небольшом росте цен товаров, приобретаемых на заработную плату, по отношению к денежной заработной плате совокупное предложение труда работников, готовых работать за существующую денежную заработную плату, так же как и совокупный спрос на труд при этой заработной плате, превышают существующий объем занятости" [Кейнс, 1978, с. 68].

⁵ О деньгах как об общественном и даже социально-психологическом явлении, а не только как "чисто" экономическом феномене см., например, [Aglietta, Orlean, 2002].

маржиналистской революции, интерес к субъективному⁶ достаточно быстро исчерпал себя: в неоклассической теории, по существу, он свелся к положению, согласно которому функции предпочтения не обсуждаются, а экономическое поведение отождествляется с оптимизацией.

Иными словами, несмотря на новые тенденции в физике, которые, казалось, указывали на ограниченность механистического подхода, и несмотря на интерес к субъективной стороне экономических явлений, с одной стороны, и развитие эмпирических исследований - с другой, победа в экономической науке осталась за детерминизмом и универсализмом. Не случайно, весь XX в. австрийцы пытались отмежеваться от равновесной детерминистской картины экономического мира, с которой они оказались связанными в силу методологического недоразумения⁷. Но методологические перипетии австрийской школы - это уже другая история.

Вероятностная логика в контексте английской философии начала XX в.

Важную роль в формировании характера экономической науки XX в. сыграл логический позитивизм, представленный в Англии прежде всего Б. Расселом и Э. Уайтхедом, которые вместе с Дж. Муром оказали большое влияние на Кейнса. Исследовательская программа логического позитивизма, как известно, предполагала приложение средств математической логики к теоретико-познавательным проблемам; перенос внимания от объекта к образу и языку, дрейф в сторону восприятия реальности как модели (что, очевидно, имело огромное значение для экономической теории XX в.), а также стремление **преодолеть разрыв между субъективным и объективным**. Все это вместе можно считать неким философским импульсом в сторону модельного видения экономических процессов, столь широко укоренившегося в XX в., и оказалось очень созвучным философской позиции Кейнса и его теории.

В области этики наставником Кейнса стал Д. Мур с его идеей невозможности определения добра и сведения этого понятия к чему-то более простому, в которой можно увидеть некий прообраз кейнсовых представлений о несводимости целого к сумме частей, лежащих в основе его холистической позиции. И эта несводимость, очевидно, связана с принципом неинтенационности результатов действий экономических субъектов. Идея неинтенационности, как известно, была воплощена в тезисе о "невидимой руке". Но у Кейнса мы имеем дело с несколько иной трактовкой.

У А. Смита речь шла, по существу, только о положительных социальных последствиях эгоистических устремлений экономических субъектов, и при этом фактически предполагалось, что оценка результата их совместных действий дается неким внешним наблюдателем. У Кейнса логика иная: правильные с точки зрения каждого действия в результате взаимодействия с правильными поступками других субъектов приводят к результату, который сам человек расценивает как плохой. Но признав этот факт и следуя логике Кейнса, мы неизбежно приходим к вопросу, который выходит за рамки собственно экономической теории, - если следование разумным правилам в "высшей степени сложном течении реальных событий" не гарантирует хорошего результата, то на что может положиться человек, определяя свои действия? Ответ Кейнса - неожиданный с точки зрения человека эпохи рационализма - на собственную интуицию.

⁶ Говоря о маржиналистской революции в целом и об ее австрийской составляющей в частности как о явлении, связанном с внутренними проблемами экономической науки, не будем забывать и о том, что замена диктата производителя диктатом покупателя имела вполне реальную материальную основу, связанную с развитием массового производства и достижением им определенного уровня. Но этот сюжет - о влиянии изменений в технологии и организации производства на общественные институты - предмет специального рассмотрения.

⁷ В борьбе австрийцев за восстановление своей методологической репутации исключительная роль принадлежит Ф. Хайеку (см., например, [Хайек, 2000; Hayek, 1978, ch. 1]).

Но в этом случае возникает опасность - коллизия между обыденным знанием, в котором интуиции отведена если не решающая, то во всяком случае весомая роль, и научным знанием, стержнем которого является логика и из которого интуиция изгонялась как недостойная уступка человеческому несовершенству. Кейнс пытается разрешить эту коллизию и разрушить непреодолимую грань между обыденным и научным знанием, но, делая это, он не придает экономическому субъекту черты логика, а соединяет в научном знании логику и интуицию. Более того, он признает интуицию исходным моментом в том смысле, что полагает: логическому рассмотрению проблемы предшествует ее осознание на интуитивном уровне.

Разумеется, здесь таится серьезная опасность. Хотя и признается, что "интуитивный взгляд, безусловно, должен основываться на том, что Кейнс назвал широким знакомством с фактами, всегда существует опасность того, что интуиция может больше опираться на фантазию, чем на факты" [Gruchy, 1983, p. 257]. И здесь методологическая проблематика перекрещивается у Кейнса с проблематикой теории знания, при этом связующим звеном оказывается проблема неопределенности.

Обращение к проблеме неопределенности в гносеологическом контексте неизбежно приводит к необходимости критического осмысления понятия вероятности. Вместе с Г. Джеффрисом Кейнс считается основоположником одного из направлений теории познания - вероятностной логики, которая, по существу, претендует на роль общей теории индуктивной логики. *Raison d'être* этого направления определяется необходимостью обсуждать события в областях, где не существует научной основы для исчисления вероятности или присутствует истинная неопределенность, то есть в области возможного в отличие от области данного или невозможного⁸.

Спустя многие годы после публикации "Трактата о вероятности" (1921 г.), где он изложил основы вероятностной логики, Кейнс показал значение своего подхода для экономической теории, которая не игнорирует такую неудобную вещь, как неопределенность. Он писал: "под "неопределенным" знанием я не имею в виду просто разграничение между тем, что известно наверняка, и тем, что лишь вероятно. В этом смысле игра в рулетку или выигрыш в лотерею не является примером неопределенности... Я употребляю этот термин в том смысле, в каком неопределенными являются перспектива войны в Европе или цена на медь и ставка процента через двадцать лет, или устаревание нового изобретения... Не существует научной основы для вычисления какой-либо вероятности этих событий. Мы этого просто не знаем. Тем не менее необходимость действий и принятия решений вынуждает нас как практических людей сделать все от нас зависящее, чтобы обойти этот досадный факт и вести себя точно так, как если бы мы основывались на добром бентамовском исчислении серий ожидаемых выгод и потерь, каждая из которых была бы помножена на соответствующую вероятность при суммировании. Как в этих обстоятельствах нам удастся вести себя таким образом, чтобы сохранить себя как рациональных субъектов, экономических людей?" [Кейнс, 2000, с. 284].

Речь идет, таким образом, о сочетании предпосылки о рациональности с предпосылкой о неопределенности, которая неизбежно присутствует, когда речь идет не о серий-

⁸ В 1921 г. Ф. Найт обращался к этой проблеме в книге "Риск, неопределенности и прибыль" (М., 2003) и в статье "Понятия риска и неопределенности". Он высказывал точку зрения, близкую Кейнсу: указывал на странность разрыва между представлениями о научном знании, которое имеет дело с вероятностью как частотой, и обыденным знанием, которое "работает" по принципу аналогии, говорит о возможности преодоления этого разрыва. Он ссылается на единство мира, оправдывающее использование аналогии; говорит о том, что частотное представление о вероятности - применимо только к повторяющимся событиям, причем в данном случае вероятность является характеристикой всей последовательности событий. При этом Найт не ставил проблему источника неопределенности, то есть не задавался вопросом о ее гносеологической или онтологической природе (см. [Найт, 1994]). Проблема неопределенности как проблема возможного оказалась примерно в это же время в центре внимания Дж. Неймана, который пришел к ней "со стороны" квантовой физики и обозначил соответствующую область как квантовую логику.

ных (одинаковых и в одинаковых условиях совершающихся), а об уникальных событиях. Замечу, что так Кейнс фактически определяет и само понятие неопределенности.

Напомню, что в традиции классической науки вероятность трактовалась как объективная характеристика объекта. Ее оценка предлагалась либо в рамках аксиоматической теории - вероятность сложных событий определялась по математическим правилам на основе вероятности событий их составляющих, либо в рамках частотной теории как доля благоприятных исходов в их общем числе (П. Лаплас) или как некий предел, к которому эта частота стремится (об этом писали еще Я. Бернулли, а позже Д. Венн, Г. Рейнхенбах и др.). В этом случае вопрос об оценке вероятности был связан с проблемой нашего знания и его масштабов.

В отличие от классической трактовки вероятностная логика рассматривает вероятность как характеристику не явления, а наших представлений о нем, а именно, как степень **разумной (рациональной)** уверенности (убежденности) (*rational believes*) в истинности той или иной гипотезы. В этом случае нет непосредственной связи между истинностью утверждения и степенью рациональной убежденности, поскольку при такой трактовке вероятность - характеристика не истинности самого утверждения, а лишь обоснованности убежденности, что оно истинно. От обычной логики вероятностная логика отличается тем, что приписывает высказываниям не только значения "истинно" или "ложно", но и допускает некоторую промежуточную оценку - "возможно". При этом Кейнс - и это важно - связывает данную оценку (как, впрочем, и две предыдущие) со степенью нашей уверенности в истинности данного утверждения, а не с характеристикой события как такового. Очевидно, что степень разумной уверенности зависит от внешних условий, знаний человека, который оценивает ситуацию, его способностей и т.д.

Определяя задачу своей главной философской работы - "Трактата о вероятности", Кейнс писал, что она "посвящена общей теории аргументации, позволяющей на основе предпосылок прийти к выводам, которые обоснованы, но не являются безусловными" [Keynes, 1962, p. 98]. **Принципиально важными являются следующие моменты:**

- степень разумной уверенности не связана напрямую с содержанием гипотезы: можно рационально придавать высокую степень обоснованности утверждению, которое потом оказывается ложным, но этот факт несколько не подрывает обоснованности убежденности;

- вероятность представляет собой не внутреннюю характеристику предположений и аргументов, а относительное свойство, связывающее утверждение со свидетельствами в его пользу;

- степень разумной уверенности, или вероятность, одного и того же утверждения может быть различной в зависимости от обстоятельств, причем эта характеристика относится к уже состоявшемуся событию, и последующие свидетельства неадекватности самого утверждения не могут изменить сделанную ранее при иных условиях оценку степени рациональной уверенности. Это соображение важно для историков науки, поскольку позволяет признать рациональными старые, впоследствии оказавшиеся неверными теории. В этом случае перед историками встает вопрос - не почему люди держались за старые заблуждения и сопротивлялись новым идеям (это было как раз рационально и понятно), а что побудило их в какой-то момент пересмотреть степень рациональной убежденности в правильности этих старых теорий⁹ ;

- дать этой вероятности численное значение сложно, более того, сложно даже упорядочить различные вероятности. И причина прежде всего в том, что не соблюдается требование идентичности условий, при которых формируется данное утверждение и оценивается степень уверенности в нем. Однако в действительности люди постоянно сравни-

⁹ Рассуждая о том, что людям свойственно придерживаться сложившихся мнений и представлений, а затем происходит нечто, побуждающее их отказаться от этих мнений, мы затрагиваем область эволюционной экономики и даже более конкретно - явления, не очень адекватно названного на русском языке как "зависимость от прошлого" в приложении к развитию идей.

вают вероятности, полагаясь на интуицию и на то, что называется обыденным знанием. Обычно сравнение вероятностей означает просто предпочтение одного утверждения другому;

- индивиды "борются" с неопределенностью, прибегая к конвенциональным суждениям: зная, что индивидуальное суждение может быть ложным, они стремятся опереться на суждения других людей, которые, возможно, лучше осведомлены, то есть человек пытается в своих суждениях соответствовать мнению большинства. Таким образом, возникает нечто вроде объективности субъективного.

Вероятностная логика предлагает по-новому взглянуть как на традиционную трактовку частотной вероятности, так и на понятие рациональности в экономической науке, и в связи с последним - и на представление о самой экономической науке. Более того, вероятностная логика проливает новый свет на процесс роста знания; позволяет сформировать общий подход к анализу поведения и экономических агентов - объектов анализа и тех, кто формирует экономическое знание, - экономистов.

Значение вероятностной логики Кейнса для экономической теории

Что же дает экономисту вероятностная логика? Во-первых, **новый взгляд на рациональность**. В рамках *main stream economics* рациональность отождествляется с оптимизацией либо непосредственно, либо через принцип *as if*, то есть когда утверждается, что индивиды ведут себя, как если бы они оптимизировали целевую функцию (которая, разумеется, известна индивиду) при заданных ограничениях (о которых индивид имеет точное представление). При этом предполагается, что как побудительный мотив корыстный интерес обеспечивает непротиворечивость действий субъекта, касающихся и себя, и окружения. Критика мейнстримовского понимания рациональности идет по некоторым направлениям, одно из которых касается связи между рациональностью и знанием. Недостаток знания рассматривается как причина нерациональности. Хотя Г. Саймон попытался преодолеть это, введя понятие ограниченной рациональности [Саймон, 1993; Теория... 1995], он не уделял достаточного внимания неожиданным результатам, возникающим в результате действий в условиях неопределенности.

Кейнс же говорил о рациональности как характеристике логики. Рациональность допускает, что, зная одно утверждение, из которого не следует с неизбежностью истинность другого, мы имеем некоторое рациональное основание верить в истинность последнего. В этом случае многие стороны жизни рассматриваются как рациональные. Здесь открывается путь к анализу поведения инвесторов в условиях неопределенности, особенностью которого является *animal spirit*, или стадное чувство.

Стадное чувство, толкающее инвесторов к специфическому поведению на рынке ценных бумаг, о котором Кейнс писал в "Общей теории занятости, процента и денег" и которое разъяснял в статье "Общая теория", он связывал с неопределенностью и ограниченностью знаний у инвесторов. Инвесторы, осознавая ограниченность информации, которой владеют (и, возможно, интуитивно чувствуя, что часть информации, необходимой им для принятия "хорошего" решения, в данный момент еще не существует), и своих возможностей правильно ее оценить, полагаются на мнение других. Подобное (конвенциональное) поведение инвесторов и последствия, с ним связанные, представляют главную теоретическую новацию Кейнса при описании денежного рынка и рынка капитала и в конечном счете являются ключевыми для объяснения механизма возникновения вынужденной безработицы. Но неизбежно должен возникнуть вопрос: насколько подобное поведение согласуется с базисными аксиомами теории, и прежде всего с аксиомами индивидуального поведения?

Если исходить из того, что эта аксиоматика Кейнса не отличается от аксиоматики неоклассики, и принять определение рациональности, которому следовали неоклассики, то придется согласиться с тем, что поведение инвесторов у Кейнса нерационально. Если же исходить из того, что Кейнс иначе, чем неоклассики, трактовал понятие рациональности, что он следовал вероятностной логике, то подобное поведение инвесторов предстает

в ином свете, а именно как вполне рациональный способ "борьбы" с истинной неопределенностью. В этом случае основанные на интуиции и даже слухах действия представляются рациональными, а их последствия, прежде всего вынужденная безработица, вписываются в общую логику теории. И уже нет нужды "цепляться" за предпосылку о жесткости цен или заработной платы, чтобы сохранить логику теории, более того, даже последующие усилия "спасти" Кейнса и заменить последнюю предпосылку предпосылкой об относительно более быстрой скорости изменения количественных показателей, нежели ценовых, оказываются скорее техническим приемом, а не усовершенствованием базисной предпосылки¹⁰.

Во-вторых, вероятностная логика открывает экономисту **новый взгляд на деньги**. Вообще следует заметить, что деньги - совершенно особое благо, при исследовании которого, как никакого другого, перекрещиваются философия знания, этика и экономическая теория (сегодня следует добавить - и институциональная теория). Теория Кейнса - теория денежной экономики, причем ее "денежный" характер предопределен прежде всего тем, что в экономике присутствует неопределенность. Длительная дискуссия о природе денег в чистой теории показала, что там, где нет неопределенности, нет места для денег, отличных от простой единицы счета. Не случайно, несмотря на то, что исторически интерес к проблематике денег поддерживался практикой, теория фактически не объясняла, почему деньги так важны и почему они представляют уникальный феномен хозяйственной жизни, как это хорошо известно из реальной действительности. Вряд ли в экономической науке можно назвать еще феномен, который так внимательно и заинтересованно изучался в прикладной области и так скупно в области чистой теории - во всяком случае тогда, когда современная теория формировалась.

Важно то, что современная чистая экономическая теория возникла как теория для мира, в котором нет места неопределенности; а классическая традиция с ее стремлением к универсализму рассматривала деньги как один из множества товаров. Эти два обстоятельства, по существу, предопределили неудачи будущих попыток интеграции денег в такие модели, как модель общего равновесия Вальраса, остающейся эталоном модели экономики, основанной на классической традиции (не только экономической науки, но и науки в целом)¹¹.

Когда объектом рассмотрения становится экономика, важнейшей характеристикой которой является неопределенность, ситуация меняется принципиально. Появляется возможность ввести деньги на уровне аксиоматики, рассматривая их как уникальный социально-психологический феномен, выступающий в качестве связующего звена между сложным настоящим и неизвестным будущим, посредством которого изменения в представлениях людей, часто ни на чем реальном не основанные, передаются в экономике.

Способность денег выполнять роль средств обращения и накопления основана на вере людей в особую природу денег - в них видят некий якорь надежности в мире неуверенности. На чем основана эта вера - отдельный вопрос. Легче всего и естественнее сказать, что на вере в государство, и являющегося конечным эмитентом денег. Но возможно и другое представление, которое предлагает Хайек, когда пишет о частных деньгах. Однако в любом случае не приходится сомневаться в конвенциональной природе денег. И здесь следует искать объяснение тому факту, что деньги ведут себя не так, как

¹⁰ В длительной дискуссии по этому вопросу ключевую роль сыграла книга А. Лейонхувуда [Leijonhufvud, 1968]. Эта дискуссия спровоцировала многочисленные попытки вписать ситуацию незанятых ресурсов в систему Вальраса. Возникли даже такие понятия, как "неовальрасианское" равновесие, вальрасианское неравновесие и т.д., имевшие одну и ту же цель - согласование кейнсианского результата с надежной аксиоматикой Вальраса и ортодоксальной теорией в целом. Среди участников дискуссии следует назвать Р. Барро, Г. Гросмана, Ж. Бенасси, Ж. Грамона, Р. Клауэра и др.

¹¹ Обширнейшая и длительная дискуссия на тему интеграции денег в модель Вальраса была почти полвека назад спровоцирована знаменитой работой Д. Патинкина [Patinkin, 1956; Патинкин, 2004].

все остальные товары, - они не подчинены полностью рыночному механизму. Например, если цена некоего обычного товара растет, то спрос, скорее всего, будет снижаться, в отношении денег ситуация обратная, поскольку повышение цены денег снижает спрос на них для целей обращения, при возрастании спроса для целей накопления и как гаранта надежности. Отсюда следует, что отклонение "цены" денег от равновесной не приводит в действие механизм возвращения к равновесию на рынке денег.

Процент у Кейнса, как известно, - нечто принципиально отличное от того, чем он является в классических моделях. Он непосредственно связан с деньгами и представляет собой, по существу, конвенциональную оценку степени предпочтения настоящего будущему в условиях неопределенности. Поведение процента поэтому не может быть объяснено пересечением функций сбережений и инвестиций: эти функции в их агрегатной форме достаточно инерционны, чего нельзя сказать ни о проценте, ни о ситуации на финансовом рынке.

Таким образом, начав с борьбы против денежной морали викторианства¹², Кейнс сделал шаг в сторону денежной теории, фундаментальная задача которой состояла, по его мнению, "не просто в установлении тождеств или статистических зависимостей между, например, массой денежных инструментов и оборотом того, что продается за деньги. Реальная задача этой теории состоит в том, чтобы подойти к проблеме с динамической точки зрения, анализируя различные элементы, вовлеченные в процесс, причем сделать это таким образом, чтобы выявить каузальные связи, определяющие уровень цен и способ перехода от одного состояния равновесия к другому" [Keynes, 1930, p. 133]. И здесь обозначается еще одна болевая точка чистой теории - проблема динамики, в поисках решения которой многие современные экономисты вынуждены покидать привычное русло ортодоксальной теории¹³.

Приведенная выше цитата из "Трактата о деньгах" - работы, не столь знаменитой, как "Общая теория" - ясно указывает на связь денежной проблематики и проблемы динамики. Но важно и то, что уже в этой работе, допуская возможность несовпадения структуры дохода по созданию и использованию, Кейнс не только открывает дорогу утверждению об отсутствии в экономике механизма саморегулирования (об этом в свое время с ужасом говорил Хайек), но связывает недействие этого механизма с существованием денег как особого, психологически обусловленного блага, "позволяющего" сбережениям "застрять" в каналах финансовой системы. И хотя в этой работе экономические процессы рассматриваются через призму цен, образ вынужденной безработицы как некий подтекст уже присутствует.

Вместе с изменением представлений о механизме воздействия денег на экономику и признанием фактора неопределенности определяющим феноменом экономической жизни меняются и представления о задачах денежной политики и ее возможностях. Стало привычным связывать практические рекомендации Кейнса с решением проблемы вынужденной безработицы, но множество программ в этой области - это наиболее практически значимое следствие его принципиальной философской установки - **отказа от попыток установить общие и универсальные закономерности экономической жизни.**

Готовность ставить под сомнение утвердившиеся нормы и устоявшиеся представления применительно к этике и эстетике предстала у Кейнса как интеллектуальный радикализм (причем, принимая во внимание характер провозглашаемых принципов, радикализм антидемократический). Применительно к экономической теории эта готовность обернулась, во-первых, способностью пересмотреть базисные положения экономической науки, которые он унаследовал от предшествующего поколения великих кембриджцев, во-вторых, гибким отношением к своим собственным утвержде-

¹² Борьбу с коммерческой моралью викторианства и фетишем денег вели различными средствами друзья Кейнса по Блумберийскому кружку.

¹³ Примером подобного отхода является, например, эволюционная экономика (см., например, [Нельсон, Уинтер, 2000; Evolutionary... 1993]).

ниям. В области политики неконформизм Кейнса позволил легко переходить от одних задач к другим, используя при этом различные методы решения. Гибкость в политике - не гарантия успеха, но необходимое условие, и пример Кейнса это со всей очевидностью показывает. Но связь теории и политики у Кейнса - предмет специального рассмотрения.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

- Кейнс Дж. М.* Общая теория // Истоки. N 4. М., 2000.
- Кейнс Дж. М.* Общая теория занятости, процента и денег. М., 1978.
- Найт Ф.* Понятие риска и неопределенности // THESIS. 1994. Вып. 5.
- Нельсон Р., Уинтер С.* Эволюционная теория экономических изменений. М., 2000.
- Патинкин Д.* Деньги, процент и цены. М., 2004.
- Саймон Г. А.* Рациональность как процесс и продукт мышления // THESIS. 1993. Вып. 3.
- Самуэльсон П.* Экономика. Вводный курс. М., 1964.
- Теория принятия решений в экономической науке и науке о поведении // Теория фирмы. СПб., 1995.
- Хайек Ф.* Индивидуализм и экономический порядок. М., 2000.
- Aglietta M., Orlean A.* La Monnaie entre violence et confiance. Paris, 2002.
- Evolutionary and Neo-Schumpeterian Approach to Economics. Boston, 1993.
- Gruchy A. G. J. M.* Keynes's Concept of Economic Science // John Maynard Keynes - Critical Assessments. 4 vol. London, 1983.
- Hayek F.* The Keynes Century: The Austrian Critique // The Economist. June 2, 1983.
- Hayek F.* New Studies in Economics and the History of Ideas. London, 1978.
- Hayek F.* Price and Production. London, 1931.
- Keynes J. M.* A Treatise on Probability. London, 1962.
- Keynes J. M.* Collecting Writings. Vol. XXI.
- Keynes J. M.* General Theory of Unemployment, Interest and Money. London, 1936.
- Keynes J. M.* Treatise on Money. London, 1930.
- Leijonhufvud A.* On Keynesian Economics and Economics of Keynes. New York, 1968.
- Patinkin D.* Money, Interest and Prices. New York, 1956.
- Pigou A.* The Theory of Unemployment. London, 1933.
- Robbins L.* The Great Depression. London, 1934.
- Samuelson P.* Economics. New York, 1948.
- Samuelson P.* Interactions between the Multiplier Analysis and the Principle of Acceleration // Revue of Economics and Statistics. May, 1939.
- Schumpeter J.* Ten Great Economists from Marx to Keynes. London, 1997.