

Н.А. МАКАШЕВА

## “*Das Keynes Problem*”: от “Трактата о вероятности” к “Общей теории занятости, процента и денег”

В статье обсуждается вопрос о влиянии ранних философских представлений Дж.М. Кейнса в области логики и вероятности на содержание и метод его экономических работ, прежде всего “Общей теории занятости, процента и денег”. Дается краткая характеристика интеллектуальных истоков и основных идей вероятностной логики Кейнса и основные направления ее критики.

**Ключевые слова:** Дж.М. Кейнс, вероятность, вероятностная логика, неопределенность, ожидания, рациональная уверенность.

The controversial question of how J.M. Keynes’s early philosophical ideas influenced the essence and the method of his economic works, first and foremost *The General Theory of Employment, Interest and Money* is under consideration in a broad historical context. Intellectual sources, basic ideas and concepts of Keynes’s logic of probability are presented in brief as well as major criticism of Keynes’s view.

**Keywords:** J.M. Keynes, probability, logic of probability, uncertainty, expectations, rational belief.

В феврале 2011 г. исполнилось 75 лет с момента опубликования “Общей теории занятости, процента и денег” Дж.М. Кейнса – одной из самых значимых, если не самой значимой, экономической работы прошлого века. Это хороший повод не только обратиться к собственно экономической проблематике, но и коснуться менее практически ориентированных и менее известных граней творчества великого экономиста, тем более что у его главной неэкономической работы – “Трактата о вероятности” также юбилей – 90 лет со дня публикации.

Кейнс оказал такое большое влияние на экономическую и социальную жизнь современного общества, что никакие его идеи, в том числе не относящиеся непосредственно к экономической области, теперь невозможно рассматривать вне связи с системой его экономических взглядов. Знаменательно, что его работы в области экономики хронологически не были первыми, а следовали за исследованиями в области логики и философии, и это создает для историка экономической мысли захватывающую перспективу выяснить степень и характер преемственности взглядов великого экономиста.

По аналогии с известной “*Das Smith Problem*” в истории экономической мысли, обозначающей проблему связи нравственной философии А. Смита и его экономиче-

---

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

ского учения, можно говорить и о “*Das Keynes Problem*” как о проблеме связи между взглядами Кейнса в области философии и логики и его экономической теорией.

В случае Кейнса речь идет главным образом о двух работах – “Трактате о вероятности” (1921) и “Общей теории занятости, процента и денег” (1936). Однако, в отличие от “*Das Smith Problem*”, в данном случае в центре внимания оказывается не столько “противостояние” этики и экономики (хотя при анализе поведения агентов в условиях неопределенности этический аспект может быть обозначен<sup>1</sup>), сколько влияние представлений Кейнса о вероятности и неопределенности на его экономическую теорию.

До некоторой степени аналогия со Смитом прослеживается и в судьбе соответствующих работ. Известно, что и после публикации в 1759 г. “Теории нравственных чувств”, которая была сразу высоко оценена современниками, Смит до 1790 г. продолжал работать над этим произведением, считая его своей главной работой. Однако в истории он остался прежде всего как автор “Богатства народов”. Кейнс работал над “Трактатом о вероятности” (если считать от первого обращения к этой теме до публикации книги<sup>2</sup>) в течение 17 лет, то есть гораздо дольше, чем над любой другой работой, включая “Общую теорию занятости, процента и денег”, но именно последняя принесла ему всемирную известность и стала одной из ключевых для экономической науки.

Историки экономической мысли нередко интересуются тем, какой философский и методологический *background* скрывается за собственно экономическими воззрениями того или иного экономиста. И ответить на этот вопрос совсем не просто, причем даже тогда, когда экономист занимался философией. В случае Смита исследователей больше всего интересовало, как согласовать явно выраженную этическую направленность “Теории нравственных чувств”, в которой рассуждения строились вокруг таких понятий, как симпатия, сочувствие, внутренний наблюдатель и т.д., и сосредоточенность на корыстном интересе как движущей силе человека в экономической сфере, характерную для “Богатства народов”.

Пример Смита не был в этом отношении единственным. Выдающимся экономистом-философом был, безусловно, Дж.С. Милль. При анализе его наследия возникает вопрос о согласовании индуктивно-гипотетического подхода, разработанного в “Системе логики” (1843), с конкретно-дедуктивным методом его политэкономических работ, прежде всего “Основ политической экономии” (1848). Для Милля логика была одновременно прикладной наукой, ветвью психологии и теорией умозаключения. Он исходил из того, что различные методы познания являются видоизменениями и комбинациями индуктивных умозаключений. Последние, в отличие от дедуктивных, позволяющих получить строгие выводы, но не порождающих новое знание, дают новое знание, которое, однако, является гипотетическим (недостоверным). В то же время Милль, как и другие классики, стремился сделать политэкономия настоящей наукой, “внедряя” в нее дедуктивный метод. И уже здесь можно увидеть некий прообраз будущей **методологической коллизии экономической науки – неосуществимого выбора между правдой и строгостью**. Замечу, что определение того, что такое правда и что такое строгость, порой представляет сложную проблему.

В истории экономической мысли существуют примеры и “бесконфликтного”, то есть непосредственного воплощения философских идей в экономическую теорию. Один из таких примеров связан с именем Ф. Эджуорта. Утилитарист, предложивший

<sup>1</sup> Об этическом аспекте, прямо или косвенно связанном с “Трактатом о вероятности” и трактовкой понятия неопределенности, см. [Greer, 2000]. В этой работе предпринята попытка, основываясь на сравнении взглядов Дж.М. Кейнса и Ф. Найта по проблеме вероятности, а также на анализе их мировоззренческих позиций, объяснить принципиально различное отношение этих авторов к рыночной системе, возможностям и целесообразности регулирования.

<sup>2</sup> Первое обращение Кейнса к проблемам вероятности, согласно Р. Скидельскому, можно отнести еще к периоду его обучения в университете, а именно – к 1904 г. Вероятности была посвящена и его диссертация, положенная в основу книги, над которой Кейнс работал, уже будучи сотрудником Департамента по делам Индии. “Трактат о вероятности” был готов в 1913 г., но опубликован только в 1921 г. [Skidelsky, 1994, ch. 3].

сложную методику исчисления удовольствия и счастья [Edgeworth, 1877], он не только признавал дедуктивный метод единственно научным, но и последовательно отстаивал его в экономике [Edgeworth, 1881]. Можно сказать, что именно с Эджуорта экономическая теория стала двигаться к тому зданию, над входом в которое вполне могло быть начертано: “Тот, кто не изучал геометрию, не может сюда войти”.

Объективно “Трактат о вероятности” был направлен против этой, пусть и широко понимаемой, тенденции, хотя сам автор вряд ли имел в виду проблемы экономической науки. Более того, его идеи в области логики и вероятности “не укладывались” и в плоскость знаменитого методологического спора в экономической науке. Тот факт, что, предложив логику нестрогого следствия, Кейнс “реабилитировал” индукцию, признав ее “законной” процедурой получения научного (но нестрогого, вероятностного) знания<sup>3</sup>, не означает, что он встал на сторону Г. Шмоллера против К. Менгера<sup>4</sup>.

Отчасти то, что философская позиция Кейнса “не вписывалась” в привычную для экономистов плоскость методологического дискурса, привело к некоторой отстраненности экономистов от его философии, а впоследствии, когда историки экономической мысли все-таки обратились к ней, предопределило и некоторую неясность в ее оценке. Суть “*Das Keynes Problem*” состоит в следующем: повлияли ли ранние философские идеи Кейнса на его экономическую теорию и могут ли они, хотя бы в некоторой степени, рассматриваться как ее философское или методологическое основание? Речь идет о связи между вероятностной логикой Кейнса, то есть логикой нестрогого следования, в которой вероятность связана со степенью веры, или убежденности (*belief*), в истинности некоторого суждения и не является характеристикой реальности, – с одной стороны, и методом и содержанием “Общей теории занятости, процента и денег”, которая предлагает более реалистический взгляд на экономику и определяет факторы, влияющие на объем производства и занятости в экономике, в которой присутствует неопределенность, – с другой.

Чтобы попытаться ответить на поставленные вопросы, необходимо прояснить побудительные мотивы написания “Трактата о вероятности” и его основные идеи, контекст восприятия этой работы и ведущие направления ее критики.

### От этики к логике и от логики к экономике

В конце XIX – первые десятилетия XX в. интерес к проблемам, которым посвящен “Трактат о вероятности”, был вызван по крайней мере двумя обстоятельствами: повышенным вниманием к проблемам эпистемологии в целом, инициированным достижениями естественных наук, прежде всего физики, а также статистики и математики, и возрождением эмпирической традиции в философии с ее интересом к получению “производного” знания на основе интуитивного и с помощью логического отношения между ними. Кейнс видел проблемы в существовавшей теории знания и стремился их устранить [Braithwaite, 1973, p. XV].

Обращение Кейнса к проблеме вероятности было связано также с его увлечением идеями Дж. Мура – этого кумира студентов Кембриджа в начале XX в., чья книга “Принципы этики” (1903) была одной из самых читаемых и обсуждаемых. Внимание Кейнса привлек конфликт между “вероятным” и “должным”, который Мур не смог разрешить.

<sup>3</sup> Кейнс также утверждал, что в каком-то смысле и наша способность делать выводы – следствие индукции и аналогии, поскольку мы прибегаем к ним всякий раз, когда учимся на опыте. Обучение же на опыте – не что иное, как получение выводов из повторяющихся наблюдений. Проблема индукции, безусловно, отдельная проблема, однако позволю себе заметить, что “реабилитация” индукции Кейнсом сегодня может восприниматься не столько как утверждение правильности индуктивной процедуры и надежности полученного с ее помощью знания, сколько как напоминание о ненадежности нашего знания вообще, в том числе и полученного дедуктивно. Сегодня экономисты признают сложность объекта, наличие обратных связей, зависимости от прошлого, а также открытость многих систем, с которыми имеет дело экономист. Все это ставит под сомнение надежность строгих причинно-следственных зависимостей.

<sup>4</sup> Об этом знаменитом споре см., например, [Шумпетер, 2001, т. 3, ч. 4, гл. 4].

Согласно Муру, этической максимой является требование действовать таким образом, чтобы принести в мир как можно больше добра, прежде всего став хорошим. “Но поскольку знание последствий наших действий неизбежно ограничено и в лучшем случае вероятно, самое большее, на что можно надеяться, – это вера в то, что действие А повлечет за собой В. Но что же делает эту веру рациональной? Именно то, что Мур не смог дать удовлетворительный ответ на этот вопрос, и побудило Кейнса к интеллектуальным изысканиям” [Skidelsky, 1984, p. 58]. Эти же самые обстоятельства заставили Кейнса уйти от философии целей, непосредственно связанной с этикой, к экономической науке как философии средств.

Опубликовав “Трактат”, Кейнс завершил многолетнее дело. Однако к этому времени этические представления, которые под влиянием Мура он и другие интеллектуалы из Кембриджа приняли, были поставлены под сомнение. Первая мировая война со всей безжалостностью показала, что стремление отдельного человека “быть лучше” (именно такой была установка последователей Мура) не очень способствует совершенствованию мира, и в то же время все труднее отстраниться от проблем этого мира человеку, который “стал лучше” или стремится к этому. Закономерно, что после войны Кейнс отошел от философии и логики и сосредоточился на экономике; в области экономической теории главной проблемой для него стала проблема макроэкономического равновесия в целом и полной занятости в особенности.

Возможно, переключение внимания на экономику было связано не только с внешними обстоятельствами, но и с сомнениями в правильности предложенного им подхода в области вероятности и логики, сомнениями, возникшими не без влияния критики, прежде всего со стороны более молодого поколения кембриджских интеллектуалов. Так, в 1926 г. в письме к немецкому переводчику “Трактата о вероятности” Ф. Урбану Кейнс писал: “Я чувствую, что в этой книге есть много того, что меня не удовлетворяет, и на самом деле, я это чувствовал и когда писал ее... Но я все еще думаю, что проблемы, как я их тогда поставил, могут быть правильной отправной точкой дальнейших исследований... Они (представители молодого поколения. – *Н.М.*) инстинктивно чувствовали возможность того, что некоторый вариант частотной теории в конце концов является более фундаментальным в отношении всей концепции вероятности, чем я полагал. Я не удивлюсь, если они окажутся правы. Однако подозреваю, что первый шаг, который следует сделать, будет связан с прогрессом в области психологии неявного знания, и что дальнейшее развитие в области логики придется отложить до того момента, когда будет разграничена вероятностная логика и то, что я назвал теорией неявного знания” (цит. по [O’Donnell, 1989, p. 145]).

Откликаясь на опубликованные в 1930 г. посмертно работы основного критика “Трактата” Ф. Рамсея<sup>5</sup>, не согласного с самой идеей новой логики, основанной на нестрогом следовании, Кейнс, хотя и в мягкой форме, признал его критику в значительной степени обоснованной [Keynes, 1972, p. 336–339]. С критикой философских взглядов Кейнса выступил и Л. Виттгенштейн, который видел задачу логики и философии не в том, чтобы отделить истинное от неистинного (это он оставлял науке), а в том, чтобы провести границу между тем, что имеет смысл, и тем, что бессмысленно. Он полагал, следовательно, что эти дисциплины не пересекаются с реальностью. В отличие от Виттгенштейна Кейнс и близкие ему философы стремились “построить мост” между философией и реальностью. Если Виттгенштейн отождествлял знание с математикой и наукой, а все остальное относил к не имеющим смысла высказываниям, то Кейнс большое значение придавал интуитивному знанию, рассуждениям, основанном на нестрогом следовании и дающим “приблизительное” знание.

---

<sup>5</sup> Франк П. Рамсей (1903–1930) – английский математик, философ, экономист. Младший современник Кейнса, один из самых талантливых выпускников Тринити-колледжа. Очень рано умерший, он внес заметный вклад во все области, в которых работал. Так, в области экономической теории классическими стали две его работы: “A Contribution to the Theory of Taxation” (1927) и “A Mathematical Theory of Saving” (1927), которые значительно опередили последующее развитие теории оптимальных цен и теории роста.

Ученые до сих пор спорят, свидетельствуют ли приведенное выше и некоторые другие высказывания Кейнса о его готовности капитулировать перед аргументацией Рамсея или о признании, что Рамсей указал направление дальнейших поисков. Но независимо от ответа на этот вопрос, нельзя отрицать того факта, что после 1921 г. (а в действительности еще раньше) Кейнс практически полностью погрузился в экономическую проблематику.

В середине 1920-х гг. Кейнс активно участвовал в дискуссиях по финансовым и валютным проблемам, разрабатывал экономическую и социальную программу либеральной партии, занимался экономической теорией. Непосредственно перед кризисом 1929 г. и в его начале он был занят работой над фундаментальным двухтомным “Трактатом о деньгах” (1930), в котором сделал первый шаг в направлении пересмотра сложившихся представлений о функционировании равновесного механизма в экономике. Начавшаяся Великая депрессия придала теоретическим разработкам Кейнса практическую значимость и одновременно стимулировала дальнейшие исследования. И хотя еще весной 1929 г. Кейнс обсуждал проблемы вероятности и логики с Л. Виттгенштейном, Ф. Рамсеем и Р. Брэттуэйтом (впоследствии редактором VIII тома из 30-томного собрания сочинений Кейнса), это было скорее неким интеллектуальным отвлечением от всепоглощающих актуальных экономических проблем, чем возвращением к старым сюжетам.

### **Вероятностная логика и экономика: преемственность или разрыв?**

“Общая теория” была новаторской работой, ставившей под сомнение многие базисные положения господствующей тогда экономической теории. Сегодня всеми признается новаторский характер этой работы, проявившийся не в последнюю очередь в оценке важности факторов неопределенности и психологии участников рыночного взаимодействия. Однако в 1930-е и последующие годы наибольший интерес вызывали иные сюжеты, прежде всего связанные с функцией эффективного спроса и потребления, мультипликатором и т.д. Читатели и комментаторы стремились выделить в “Общей теории” четкую и простую нить рассуждений, освободить текст от недосказанности и завораживающего многоголосия, представить ее в виде модели<sup>6</sup>. В дискуссиях, непосредственно вызванных публикацией “Общей теории”, практически не затрагивались не только проблемы вероятностной логики, но и проблемы неопределенности<sup>7</sup>. “Общая теория” открыла перед экономистами настолько заманчивые исследовательские перспективы, что они не испытывали потребности погружаться в чуждый для большинства из них мир философских рассуждений. Знаменательно, что интерес к проблемам неопределенности проявляли в тот период не кейнсианцы, а их идейные противники – представители австрийской школы, бывшей тогда скорее на периферии экономической науки. Поэтому невнимание экономистов к философским исканиям Кейнса, связанным с вероятностной логикой, представляется в большей степени закономерным, нежели неожиданным<sup>8</sup>.

Возрастание интереса к проблеме вероятности и философской стороне наследия Кейнса произошло в 1980-е гг. Отчасти это было подготовлено борьбой за “истинного Кейнса” против упрощенного видения его теории, которую в 1960–1970-е гг. вели представители так называемого неортодоксального кейнсианства. Они же настаивали на признании факторов неопределенности и риска, психологических мотивов поведения экономических агентов важнейшими характеристиками экономической реальности и объектами пристального внимания Кейнса [Leijohnhufvud, 1968].

<sup>6</sup> Данную линию изложения “Общей теории” можно связать с неосознанным стремлением некоторых авторов очистить эту работу от следов той логики, которую Кейнс пытался выразить в “Трактате о вероятности”.

<sup>7</sup> Весьма примечательно, что в обширнейшей “Истории экономического анализа” Й. Шумпетер не нашел оснований даже для упоминания “Трактата о вероятности”.

<sup>8</sup> Примечательно, что библиография к статье, посвященной неопределенности, в энциклопедии The New Palgrave хронологически распадается на две неравные части: из работ 1920-х гг. упоминаются только работы Рамсея и Найта, а затем идут работы уже 1950-х гг. и последующих десятилетий [Hammond, 1987].

Что касается “*Das Keynes Problem*”, то первое упоминание о вероятностной логике в связи с экономической проблематикой можно найти в опубликованной в 1938 г. рецензии Г. Тауншенда на книгу Дж. Шэкля, где в одном абзаце автор касается вопроса исчисления вероятности и оценки ее достоверности у Кейнса и Шэкля [Townshend, 1938; 1979]. Замечу, что эта рецензия, а также позиция Тауншенда, выраженная в письме к Кейнсу, вызвала несколько критическую реакцию Кейнса, который счел, что автор недостаточно точно отразил его точку зрения [Keynes, 1979].

Первой работой, специально посвященной этой проблеме, по-видимому, можно считать статью И. Хисиямы, опубликованную в 1969 г. [Hishiyama, 1995]. В этой статье автор пытался построить “мостик” между представлениями Кейнса о вероятности и некоторыми базисными положениями “Общей теории”, относящимися к функции потребления. Он обратился к процедуре агрегирования, которую трактовал как способ уменьшить неопределенность, связанную с индивидуальными решениями, и получить зависимость, которой можно доверять. В этом отношении его позиция была близка точке зрения Ф. Найта [Найт, 2003, с. 195–229].

В 1976 г. была написана работа Г.Т. Микс (опубликована лишь в 1991 г.), в которой предпринималась попытка примирить представление о неопределенности и ограниченности знания индивидов, принимающих инвестиционные решения, и принцип рационального поведения последних, обращаясь к понятию конвенциональности [Meeks, 2003]. Затем последовали публикации Т. Лоусона [Lawson, 1985], А. Карабелли [Carabelli, 1988], Р. О’Доннелла [O’Donnell, 1989], Дж. Дэвиса [The State... 1994], Б. Бэтмена [Bateman, 1996], Дж. Коатса [Coats, 1996] и др., в которых с различной степенью подробности излагались основные идеи “Трактата о вероятности”, обсуждалась их связь с “Общей теорией” и значение для всей системы взглядов Кейнса.

В ходе многолетней дискуссии, посвященной “*Das Keynes Problem*”, были поставлены следующие вопросы:

- в чем суть новаторства Кейнса в области теории вероятности и логики; какова специфика трактовки Кейнсом вероятности и неопределенности, в том числе и в сравнении с другими авторами, прежде всего Рамсеем и Найтом;

- в какой степени и в каком направлении Кейнс изменил (если это произошло) свои представления о природе вероятности после критики Рамсея и/или под влиянием других обстоятельств;

- в какой мере и в какой форме его ранние представления о неопределенности, вероятности, рациональности, индукции и других подобных вещах нашли отражение в “Трактате о деньгах” и “Общей теории”;

- как ранние представления о вероятности повлияли на признание неопределенности существенной характеристикой экономических процессов.

Дискуссия по этим вопросам продолжается до сих пор, поскольку ни на один из них все еще не получено однозначного ответа. Сегодня практически никто не утверждает, что занятия логикой и вероятностью вообще не оказали никакого влияния на дальнейшие исследования Кейнса и его взгляды по экономическим вопросам. В то же время никто не рассматривает его экономическую теорию как непосредственно опирающуюся на его идеи в области философии и логики. Различия позиций проявляются главным образом в понимании степени и характера связи между этими двумя областями.

Идею принципиального методологического единства философских и экономических взглядов Кейнса можно обосновывать (так это делает Карабелли) указанием на то, что в обеих областях Кейнс выступал против эмпиризма и принципа верификации, что он, хотя и не всегда последовательно, признавал субъективную природу вероятности. Более того, по мнению Карабелли, Кейнс рассматривал экономику в широком мировоззренческом контексте, не проводил непреодолимой границы между экономической наукой и этикой, и все это было связано с его представлениями о вероятности и неопределенности [Carabelli, 2003].

Согласно иной точке зрения, исследования Кейнса в области философии и экономики практически не пересекались, и влияние философии Кейнса на его экономическую теорию минимально. Более того, некоторые исследователи полагают, что философские работы Кейнса в некотором смысле – не более, чем этап его интеллектуального взросления, а его интерес к проблеме неопределенности и психологическим факторам, проявившийся в “Общей теории”, был следствием скорее его практической деятельности, нежели ранних философских идей [Bateman, 2003].

Существует и компромиссная позиция, признающая существование общего контекста или, может быть, мировоззренческого каркаса, объединяющего взгляды Кейнса в различных областях, сохранившегося, несмотря на критику, прежде всего Рамсея. Эту точку зрения отстаивает, например, О’Доннелл: «Рамсей действительно оказал влияние на Кейнса, но это влияние не означало полного поворота к субъективизму в вопросе о вероятности или о чем-либо еще, и было скорее непрямым, чем прямым. По сути, оно способствовало расширению кругозора Кейнса в рамках его системы взглядов и большему вниманию к различным проявлениям “слабой рациональности”» [O’Donnell, 2003, p. 89].

К этой аргументации можно добавить и некоторые соображения, касающиеся не только способа изложения “Общей теории”, но и ее метода. Как критики этой работы, так и ее почитатели отмечали как одну из ее характеристик (недостатков или достоинств) недостаточную строгость и однозначность ряда высказанных в работе положений, “зыбкость” аргументации. Именно это и создало возможность различного прочтения работы и построения на ее основе разнообразных схем. Сегодня у методологов существует понимание того, что “Кейнс последовательно отстаивал позицию, что знание не может быть более точным, чем позволяет природа его объекта” [Ананьин, 2008, с. 25]. Если принять эту точку зрения, можно высказать предположение, что его вероятностная логика является философским основанием этого неточного знания, адекватного специфическому предмету – экономике. И, имея в виду подобные представления, можно говорить о методологическом каркасе, идею устойчивости которого отстаивают некоторые исследователи наследия Кейнса.

### **“Трактат о вероятности”: вероятность и логика**

“Трактат” начинается с обсуждения сущности понятия вероятности. Основная идея Кейнса состояла в том, что вероятность следует рассматривать не как характеристику реальных событий (поэтому он отказывается от такого ключевого для “обычной” теории вероятности понятия, как “событие”), а как меру логического отношения между суждениями, выраженную *степенью рациональной веры*, или разумной уверенности (*rational belief*) в истинность некоторого суждения<sup>9</sup>. Степень уверенности *обосновывается* всем доступным в данный момент и относящимся к делу корпусом знания, и последний, будучи заданным, ее *объективно* определяет. Иными словами, можно говорить уже не о субъективной вере (зависящей от настроения или каприза индивида), а о вере *рациональной, объективной*, но при этом неполной и обусловленной.

Тот факт, что вера рациональна, свидетельствует не об истинности суждения, к которому она относится, как такового (оно всегда либо истинно, либо ложно), а о правильности рассуждения, с помощью которого мы перешли от некоторого суждения, выражающего непосредственное знание к заключению. При таком подходе поступление новой информации не превращает старую веру из *рациональной* в *нерациональную* только потому, что суждение, с ней связанное, оказалось ложным в результате появления новой информации. Что может измениться при получении большей информации, так это *степень нашей веры* в данное суждение. Таким образом, устанавливается от-

---

<sup>9</sup>Сходным образом о вероятности как связанной с некоторой степенью разумной уверенности размышляли примерно в то же самое время и некоторые другие авторы, например, Д. Ринч и Х. Джеффрис. Однако Кейнс был первым, кто заявил, что неполная, частичная, уверенность должна подтверждаться знанием логического вероятностного отношения.

ношение между суждениями, и поскольку наша рациональная вера не является полной (совершенной, абсолютной), а лишь частичной (мы лишь знаем что-то о суждении, но не само суждение), установленное отношение – *вероятностное отношение* некоторой степени.

Это отношение аналогично логическому следствию, но не предполагает строгое следование, а вероятность свидетельствует о некоторой степени уверенности (веры) – меньшей, чем достоверность. Указанное отношение и есть предмет новой теории вероятности, которая при таком понимании предстает логической теорией, а поскольку это отношение – вероятностное, то соответствующая логическая теория получает название вероятностной логики. Можно сказать, что логика распространяется на область вероятного, а теория вероятности проникает в область гносеологии.

Данная логика, с точки зрения Кейнса, носит более общий характер – обобщения дедуктивной логики, и в каком-то смысле она более реалистична (Кейнс в отличие от его критиков допускает подобную характеристику). Во-первых, она допускает как строгое следование, то есть доказательство (предельный случай нестрогого следования), так и нестрогое следование, дающее *некоторые основания* для принятия данного утверждения. Во-вторых, она согласуется с реальной практикой рассуждений в условиях ограниченности нашего знания, практикой, которая была выработана в ходе эволюции наших ментальных способностей. В-третьих, новая логика Кейнса позволяет применить понятие вероятности к ситуациям, к которым понятие вероятности как частоты неприменимо, то есть к уникальным событиям и ситуациям, когда все возможные исходы неизвестны.

Понятие вероятности как связанной со *степенью* рациональной веры предполагает, что вероятность в *некотором смысле* носит количественный характер, а вероятностная логика допускает *сравнение* этих степеней и возможность совершать с ними алгебраические действия. Кейнс полагал, что вероятность (в его смысле) – не число, но при этом считал, что вероятности можно сравнивать по степени их “весомости”. Подчеркну: Кейнс рассматривал вероятность как величину объективную и потому отвергал способ оценки через пари (или страховую премию), принятый при оценке субъективной вероятности. Кейнс подчеркивал, что ставки пари (или страховая премия) нельзя интерпретировать как вероятности, поскольку для успеха страховщику достаточно лишь того, чтобы нашлись желающие заключать договор по соответствующим ставкам<sup>10</sup>.

Критики теории Кейнса поставили под сомнение трактовку понятия вероятности как степени рациональной веры, связанной с вероятностным отношением между суждениями. Они высказали несогласие с тем, что вероятность как степень веры носит объективный характер, не имеет числовой природы, но подобные вероятности могут быть сравнимы. Наконец, немногие были готовы отказаться от общего характера частотной теории вероятности, как это предлагал Кейнс.

Главный критик Кейнса Рамсей писал, что “по-видимому, на самом деле не существует ничего такого, что он (Кейнс. – *Н.М.*) описывает как вероятностные отношения... по крайней мере в некоторых случаях эти отношения могут быть объектом восприятия, но если говорить обо мне, то я совершенно уверен, что это не так. Я не воспринимаю их, и чтобы меня убедить в их существовании, необходимо привести аргументы; более того, я сильно сомневаюсь в том, что и другие люди их воспринимают, потому что они демонстрируют очень мало согласия относительно того, какое из этих отношений связывает любые два суждения” [Рамсей, 2011, с. 424–425].

Критике была подвергнута и позиция Кейнса, касающаяся проблемы измерения и сравнения степеней веры. Кейнс исходил из того, что это сравнение возможно (в терминах “больше” и “меньше”), хотя и не существует численного выражения степеней уверенности (рациональной веры). Для подтверждения своей точки зрения он приво-

<sup>10</sup> Одна из возможных и даже часто возникающих – ситуация, когда страховщик получает прибыль при любом исходе.



дил пример нашего восприятия интенсивности цвета. Кейнс, в частности, утверждал, что вполне можно говорить, что какая-то вещь более зеленая, чем другая, не уточняя, насколько или во сколько раз она более зеленая. На это ему возражали, что “больше” и “меньше” предполагают количественную меру (в данном случае это физическая характеристика – интенсивность), хотя она может быть нам и неизвестна.

Рамсей и некоторые другие критики Кейнса исходили из того, что степень уверенности имеет отношение к характеристике внешнего мира, и в случае объективной вероятности – это обычное отношение благоприятных исходов ко всем возможным. При этом существует и субъективная интерпретация вероятности, которая относится уже к области не логики, а психологии. В отличие от рациональной (объективной) степени веры, которая в отношении одного и того же события должна быть примерно одинаковой у всех разумных людей, владеющих сходной информацией (кейнсианская интерпретация), субъективная вера предполагается различной, но в то же время измеримой – через ставки пари. Рамсей доказал, что если ставки пари непротиворечивы, то есть никто не может проиграть или выиграть независимо от действий других, их можно интерпретировать как вероятности и соответствующим образом работать с ними. В этом и состоит смысл теоремы Рамсея–де Финети, которая лежит в основе субъективной теории вероятности [Gillies, 2006].

С точки зрения Рамсея, основным пороком рассуждений Кейнса было то, что он смешивал формальную логику и логику человеческого поведения. Действительно, в нашей обыденной жизни мы чаще всего делаем заключения типа: если имеет место А, *скорее всего* будет (или не будет) иметь место В. Но, с точки зрения Рамсея, это частичное следование не имеет отношения к логике как специфической области знания, которая устанавливает правила построения рассуждений, хотя оно и отражает реальное поведение людей, не обладающих достаточным знанием или способностями, чтобы установить строгое следование.

Если интерпретировать позиции Рамсея и Кейнса таким образом, то утверждение некоторых исследователей, что после критики Рамсея Кейнс занял некоторую *среднюю* позицию между “изначальной логической теорией вероятности и субъективной теорией” [Gillies, 2006, p. 209], может выглядеть убедительным только благодаря неясности смысла понятия “средняя”.

### **Неопределенность, или Где сходятся “Трактат о вероятности” и “Общая теория”**

Сегодня практически все признают, что понятие неопределенности – фундаментальный элемент экономической теории Кейнса. Поэтому стремление выяснить смысл этого понятия, опираясь на “Трактат о вероятности”, вполне естественно. Однако здесь возникают определенные трудности. Во-первых, в “Общей теории” лишь одна прямая ссылка на “Трактат о вероятности” – в главе 12, посвященной долгосрочным ожиданиям и рынку капитала. И это не случайно: именно в данной главе речь идет о несовершенстве знаний экономических агентов и их озабоченности надежностью своих прогнозов, наконец о том, какое решающее влияние на характер функционирования рынка капитала оказывает неопределенность и ограниченность знаний агентов, особенности психологии. Кейнс подчеркивает, что экономические агенты не только строят прогнозы, но и дают оценки их надежности. Интересно, однако, что здесь Кейнс вместо термина “вера” (*belief*) – ключевого для “Трактата”, использует слово “уверенность”, “доверие” (*confidence*). И подобный терминологический сдвиг заставляет задуматься, стал ли он результатом сознательного решения уйти от проблем вероятности и логики и строить экономическую теорию независимо от старых философских идей или же Кейнс счел в данном контексте термин “уверенность” более адекватным. Однозначно ответить на этот вопрос вряд ли представляется возможным.

Во-вторых, в “Трактате” Кейнс непосредственно не занимался проблемой неопределенности, и соответствующий термин если и употреблял, то в качестве прилагатель-

ного “неопределенный” (*uncertain*). Причем, достоверность (*certainty*) он трактовал как максимум на шкале вероятности, противоположный конец которой занимала не неопределенность, а невозможность. Поэтому представляется не очень убедительным вывод, который из правильной посылки делает О’Доннелл: «...вероятность есть мера “степени достоверности” и, следовательно, – неопределенности» [О’Donnell, 1989, р. 77]. Кейнса интересовали точки, расположенные на шкале достоверности внутри отрезка от нуля до единицы. Вопрос же об отношении Кейнса к неопределенности в “Трактате” остается открытым.

Не случайно при обсуждении точки зрения Кейнса на проблему неопределенности авторы либо обращаются к высказываниям Кейнса из его экономических работ, в которых непосредственно затрагивается эта проблема, либо предлагают реконструкцию его возможной точки зрения, основанную на идеях “Трактата”<sup>11</sup>.

“Трактат о вероятности” позволяет нам судить об истоках представлений Кейнса о рациональности, отраженных в “Общей теории”. С точки зрения Кейнса, одной из наиболее важных черт поведения финансовых спекулянтов является то, что они пытаются справиться с неопределенностью и ограниченностью знания, опираясь не на строгий расчет ожидаемой доходности реальных активов, а на интуицию в отношении оценок, которые рынок может дать бумагам, неким образом представляющим эти активы. Иными словами, эти агенты действуют по законам не только и не столько экономической теории, сколько психологии.

В “Общей теории занятости, процента и денег”, статьях “Общая теория занятости” (1938), “Экономические возможности наших внуков” (1928) [Кейнс, 1998<sup>a</sup>; 2009] Кейнс касался вопроса о психологической основе стремления людей к обладанию деньгами. Он утверждал, что люди склонны верить в деньги как средство, способное уменьшить если не неопределенность, то по крайней мере ее последствия для отдельного человека. Отсюда особое отношение людей к деньгам как к чему-то очень важному. И это обстоятельство должно быть соответствующим образом отражено в экономической теории.

Возникает вопрос, можно ли и если да, то всегда ли, считать подобное представление и соответствующее ему поведение *рациональными*? С этим, на мой взгляд, связана одна из загадок связи между “Трактатом” и “Общей теорией”. Однозначного ответа на этот вопрос мы у Кейнса не находим. Некоторые рассуждения в его экономических работах, показывающие, что покоящееся на индивидуальных оценках поведение может приводить к потерям для всей группы, дают определенные основания полагать, что ответ может быть отрицательным. Во всяком случае, с точки зрения морали Кейнс осуждает погоню за деньгами и ставит под сомнение их способность выполнять роль якоря стабильности в мире неопределенности.

Вместе с тем его трактовка поведения спекулянтов в “Общей теории” скорее говорит в пользу положительного ответа. В соответствии с “Трактатом” степень разумной уверенности обусловлена имеющейся и относящейся к данной ситуации информацией. Всевозможные слухи, на которые реагируют финансовые спекулянты, несут информацию, обосновывающую веру в то или иное движение рынка. Кризис в данном случае представляется результатом действий индивидов, убежденных, что ситуация на рынке радикально изменилась. При такой трактовке эффективным способом влиять на поведение агентов и, следовательно, на рынок становится воздействие на информационные потоки. Об этом как о важнейшей задаче государства Кейнс писал еще в 1926 г. в работе “Конец *laissez faire*” [Кейнс, 1998<sup>b</sup>].

---

<sup>11</sup> Одну из таких реконструкций предложил О’Доннелл. С его точки зрения, неопределенность связана с ограниченностью познавательных возможностей человека и информации, которой он располагает. В терминах “Трактата” это означает, что мы не знаем, истинно или ложно некое суждение; информация, которой мы руководствуемся (что выражается в весах очевидности), ограничена; мы не знаем вероятностного отношения между суждениями. Эта линия рассуждения позволяет связать (или, лучше сказать, попытаться это сделать) идеи “Трактата” и трактовку неопределенности в “Общей теории” [О’Donnell, 2003].

Неопределенность как онтологическая черта современной экономики и принципиальная ограниченность знания не только экономических агентов, осознающих, чувствующих или только догадывающихся об этом факте, но и тех, кто исследуют экономику, поведение экономических агентов и динамику рынка, – все это сегодня приобретает особый смысл. Кризисные явления последних лет не только побуждают к обсуждению вопросов эффективности (или неэффективности) существующих методов регулирования и адекватности соответствующих инструментов, качества тех или иных моделей и способов их улучшения (например, призыв отойти от принципа репрезентативности и сосредоточиться на взаимодействии экономических агентов, распространить понятие экстерналий на финансовый сектор и т.д.). Они активизировали дискуссию по фундаментальным вопросам, затрагивающим философские и методологические основы экономической науки. В конечном счете, речь идет о признании того, что “метод имеет значение” [Lawson, 2009].

Вызов брошен не только ортодоксальной экономической теории и построенным на ее основе моделям, но представлениям о характере нашего знания, о его границах и надежности. Одним из объектов подобной критики стало моделирование, методологическое основание которого – представление о том, что события связаны между собой причинно-следственной зависимостью, и следовательно, убежденность в том, что при определенных условиях с неизбежностью (возможно, в среднем) должно происходить некоторое предсказуемое событие. Поскольку подобным требованиям удовлетворяет теория, основанная на атомарном подходе, под ударом оказывается и соответствующий подход в том виде, в каком он воплощен в экономических теориях *mainstream*.

Таким образом, речь идет уже не о призыве заменить кейнсианскими моделями модели новой классики, монетаризма и т.д. и всем вновь стать кейнсианцами или об обращении в кейнсианскую веру политиков и практиков. Тем более, что большинство последних, по существу, кейнсианцы<sup>12</sup>. Речь идет о формировании нового видения экономической реальности, то есть о движении в том направлении, которое было намечено Кейнсом в 12-й главе “Общей теории занятости, процента и денег” и статье “Общая теория занятости” и которое опирается на представления о характере нашего знания, отраженном в “Трактате о вероятности”. Однако реакцию экономической науки на последний кризис можно трактовать скорее как защитную, нежели как предвещающую принципиальные и глубокие изменения, подобные тем, которые известны как кейнсианская революция.

#### СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

- Ананьин О.И. Искусство экономики и/или прикладная экономика. Методологический анализ // Экономика как искусство: методологические вопросы применения экономической теории в прикладных социально-экономических исследованиях. М., 2008.
- Кейнс Дж.М. (1938) Общая теория занятости // Истоки. Вып. 3. М., 1998<sup>a</sup>.
- Кейнс Дж.М. (1928) Экономические возможности наших внуков // Вопросы экономики. 2009. № 6.
- Кейнс Дж.М. Конец *laissez faire* // Истоки. Вып. 3. М., 1998<sup>b</sup>.
- Найт Ф.Х. Риск, неопределенности и прибыль. М., 2003.
- Рамсей Ф.П. (1926) Истина и вероятность // Истоки. Вып. 7. М., 2011.
- Шумпетер Й. История экономического анализа. В 3 т. СПб., 2001.
- Bateman В. W. Keynes's Uncertain Revolution. Ann Arbor, 1996.
- Bateman В. W. The End of Keynes and Philosophy? // The Philosophy of Keynes's Economics. London–New York, 2003.
- Braithwaite R. B. Editorial Foreword // The Collected Writings of John Maynard Keynes. 30 vols. Vol. VIII. London, 1973.

<sup>12</sup> В современном мире политика борьбы с кризисом так или иначе сводится к стимулированию спроса с помощью бюджетных вливаний. Новое сегодня здесь, пожалуй, лишь то, что эти вливания осуществляются через сложную систему, и непосредственными получателями этих вливаний оказываются финансовые институты, сыгравшие едва ли не главную роль в финансовом кризисе.

- Carabelli A.* Keynes: Economics as a Branch of Probable Logic // The Philosophy of Keynes's Economics. London–New York, 2003.
- Carabelli A.* On Keynes's Method. Basingstoke, 1988.
- Coats J.M.* Claims of Common, Sense: Moore, Wittgenstein, Keynes and the Social Sciences. Cambridge, 1996.
- Edgeworth F.Y.* Mathematical Psychics. London, 1881.
- Edgeworth F.Y.* New and Old Methods of Ethics. Oxford, 1877.
- Gillies D.* Keynes and Probability // The Cambridge Companion to Keynes. Cambridge, 2006.
- Greer W.B.* Ethics and Uncertainty. The Economics of John M. Keynes and Frank H. Knight. Cheltenham (UK)–Northampton (Mass.), 2000.
- Hammond P.J.* Uncertainty // The New Palgrave. 4 vols. Vol. 4. Basingstoke, 1987.
- Hishiyama I.* The Logic of Uncertainty according to J.M. Keynes // John Maynard Keynes. Critical Assessments. 4 vols. Vol. 1. London, 1995.
- Keynes J.M.* Letters to H. Townshend, 27.07.1938; 7 Dec. 1938 // The Collected Writings of John Maynard Keynes. Vol. XXIX. London, 1979.
- Keynes J.M.* The Collected Writings of John Maynard Keynes. Vol. XX. London, 1972.
- Lawson T.* The Current Economic Crisis: Its Nature and the Course of Academic Economics // Cambridge Journal of Economics. 2009. Vol. 33. № 3.
- Lawson T.* Uncertainty and Economic Analysis // Economic Journal. Vol. 95. December 1985.
- Leijohnhufvud A.* On Keynesian Economics and the Economics of Keynes. New York–Oxford, 1968.
- Meeks J.G.T.* Keynes on the Rationality of Decision Procedures under Uncertainty // The Philosophy of Keynes's Economics. Probability, Uncertainty and Convention. London, 2003.
- O'Donnell R.M.* Keynes: Philosophy, Economics and Politics. The Philosophical Foundations of Keynes's Thought and Their Influence on his Economics and Politics. London, 1989.
- O'Donnell R.M.* The Thick and the Thin of Controversy // The Philosophy of Keynes's Economics. Probability, Uncertainty and Convention. London, 2003.
- Skidelsky R.* John Maynard Keynes. Vol. 2. The Economists as Saviour 1920–1937. London, 1994.
- The State of Interpretation of Keynes. Boston, 1994.
- Townshend H.* Letter to J.M. Keynes. 25 Nov. 1938 // The Collected Writings of John Maynard Keynes. Vol. XXIX. London, 1979.
- Townshend H.* Review of Shackle's *Expectations, Investment and Income* // Economic Journal. September 1938. Vol. 48. № 191.

© Н. Макашева, 2011