シュンペーターとナイト―不確実性をめぐって

楠木敦（北星学園大学）

I　目的

本報告は，フランク・ナイト（1885-1972）の『危険・不確実性および利潤』（1921 年，以下『利潤』と略記）における理論的枠組みが，ヨーゼフ・シュンペーター（1883-1950）の『経済発展の理論』（1912 年，以下『発展』と略記）における理論的枠組みを敷衍することによって組み立てられたものであることを示す．その際，中心となるのは不確実性であり，これまで論じられることのなかったシュンペーターの不確実性の概念も，ナイトの不確実性の概念と照合することで，明らかになるであろう．黒木が，ナイトの『利潤』における「彼［フランク・ナイト］の理論的基礎を確定する作業がなされてはじめて，思想の統一的な理解も可能になると思われる」（黒木 2001, 43, ［ ］内は引用者）と述べているように，ナイトの不確実性の淵源を明らかにすることは，ナイトに対する理解を進展させる上でも重要な作業になると思われるし，これまで論じられることのなかったシュンペーターの不確実性の概念を明らかにすることは，今後，シュンペーター研究を豊饒化していくにあたっても重要な作業になると思われる．また，ナイトの『利潤』のもととなった博士論文「企業利潤の理論」（1916 年）はアレン・ヤング（1876-1929）の指導のもとに書き上げられたのであるが，そのヤングはシュンペーターと親友であったこと，そして，ナイト自身が「企業利潤の理論」や『利潤』の中で，シュンペーターの『理論経済学の本質と主要内容』（1908 年）や『発展』に言及していることなどを考え合わせるならば，ナイトがシュンペーターの影響を受けている可能性を考慮することは，自然なことのように思われる．

II　先行研究

酒井が，「ナイトとシュンペーターの関係は，従来軽視されがちであったことは否めず，まことに不可思議な話と言わねばならない」（酒井 2010, 129）と指摘しているように，ナイトとシュンペーターの関係を論じる文献は，ほとんど見当たらない．このような状況の下で，先行研究として挙げることができるのは，ブラウワーの研究（Brouwer 1991; Brouwer 1996; Brouwer 2002）と池本の研究（池本[2004]2013）であろう．まず，後者の池本の研究は，シュンペーターとナイトを仔細に比較して論じることはしておらず，両者の類似点というよりはむしろ両者の相違点を指摘することに主眼が置かれている（池本[2004]2013, 192-194）．次いで，前者のブラウワーの研究は，シュンペーターからナイトへの影響関係を論じているが，局所的な影響関係の指摘にとどまっており，本報告で明らかにするような不確実性の側面に関しては，影響関係を認めていない．ブラウワーは，「フランク・ナイトが，経済学に対して独創性に富む貢献をなした彼の『危険・不確実性および利潤』の中で，不確実性に対するシュンペーターの無視を矯正した」（Brouwer 2002, 91, 強調は引用者）と指摘する．すなわち，「ナイトは，企業者が自己選択するのではなく，投資家（investors）

によって選ばれるという発想をシュンペーターから借用したが，その投資家というものは，シュンペーターの描写とは対照的に，無謬ではなく誤謬を仮定している」（*ibid*., 92，強調は引用者）．それゆえ，「彼［ナイト］の理論は，本質的な点において，シュンペーターの理論と異なる」（*ibid*., 92，［ ］内は引用者）というのである．このように，ブラウワーは，シュンペーターが経済発展論においてナイトの定義する意味での不確実性を無視していると看做している．しかしながら，結論を先取すれば，本報告では，シュンペーターは，必ずしもナイトの定義する意味での不確実性を無視しているのではないこと，さらに不確実性の概念においてもシュンペーターからナイトへの影響関係が見られることを明らかにする．したがって，これらの先行研究とは異なり，本報告は，シュンペーターの『発展』からナイトの『利潤』への影響関係を，不確実性の概念を中心として包括的に分析する．

III　不確実性の概念

ナイトは，「測定し得る不確実性と，測定し得ない不確実性との間に引かれた区別を保持するために，われわれは前者を示すために『危険（risk）』という用語を用い，後者を示すために『不確実性（uncertainty）』という用語を用いてもよいであろう」（Knight [1921] 2006, 233／訳 306）と述べ，以下のように危険と不確実性の違いを説明する．

> 危険と不確実性の 2 つのカテゴリーの間における実際的相違は，前者では諸例のグループ内の結果は（アプリオリに計算を通じてか，または過去の経験の統計かのいずれかにより）知られているが，不確実性の場合には，これは真実ではない．なぜなら，一般に，扱われる事態が高度に唯一無二であるために諸例のグループを形成することが不可能だからである（*ibid*., 233／訳 306）．

このように，危険の場合は，アプリオリに計算することが可能であり，過去の経験に基づく統計から結果を算定することも可能であるが，不確実性の場合は，そうではないという．ナイトは，危険は数量的に考量することができるが，不確実性は数量的に考量することができないと指摘する．シュンペーターも，予見可能な危険と予見不可能な危険に言及している．まず，シュンペーターは，予見可能な危険について，以下のように述べている．

> 経済にとっては 2 種類の危険が問題となる．生産の技術的失敗の危険――これにさらに自然現象によって惹き起こされる財の損失の危険をも含めることができよう――および実業上の損失の危険である．これらの危険が予見される限りにおいては，それらは直接に経済計画に影響する．経済主体は危険に対するプレミアムを生産費の計算の中にくわえるか，あるいはある種の危険を避けるための出費をするであろう（Schumpeter [1912] 2006, 49，強調は引用者）．

そして，「より大きな危険に対する補償がより大きな収益に見えるのは単に外見上のことにすぎない．それはまさにある確率係数を乗ずべきものであり，これを乗ずれば，その実際の価値は再びこのプラスの金額だけ下落するのである」（*ibid*., 50）と指摘していることから，シュンペーターは予見可能な危険の生起というものを確率であらわすことができると想定していたことが読み取れるであろう．次いで，シュンペーターは，予見不可能な危険について，以下のように述べている．

> 危険が予見されないか，あるいはいずれにせよ経済計画の中に考慮されない場合には，事態は異なってくる．その場合には危険は一方においては損失の源泉となると同時に，他方においては利潤の源泉となるであろう．…このような利潤および損失の最も豊富な源泉は，…与件の自発的な変化である．それは新しい状態を創造するものであって，これに適応するためには時間を必要とする（*ibid*., 50, 強調は引用者）．

このように，シュンペーターは，不確実性という用語を使ってはいないものの，ここで述べている「予見されない危険」は，ナイトの不確実性と同じ概念を指しているといえるであろう．シュンペーターは，ナイトに先んじて，ナイトと同じように，予見されない危険が利潤または損失の源泉になると指摘していたのである．シュンペーターの述べる「与件の自発的な変化」は，「創造的役割」（*ibid*., 33）を担う企業者によって惹き起こされる革新である．すなわち，予見されない危険は，革新と表裏一体の関係にある．

シュンペーターの革新は，自発的で非連続的な変化であり（Schumpeter 1926, 98-99／訳[上]179），「すべての関連した事実を完全に知った観察者の立場から，事後的に理解できるにすぎない．事前には，事実上，決して理解できない．…いかなる決定論的信条もこれに対して抗することはできない」（Schumpeter [1946]1991, 411-412／訳 336-337）ために，個別性と一回性を特徴とする現象であり，革新以前の経済状態とは断絶した新しい経済状態を生み出すことになる．革新を遂行する前には，何が革新であり，何が革新でないのかは分からない．革新が成功してはじめて，それが革新であったことを遡及的に理解することができるというのである．かくして，次のように革新の特質をまとめることができるであろう．第 1 に創造的な変化，第 2 に自発的（内生的）な変化，第 3 に非連続的な変化，第 4 に質的な変化，第 5 に予見不可能な変化，第 6 に不可逆的な変化である．

ナイトは，シュンペーターと平仄を合わせるかのように，「われわれの行為の論理は，真の不確定性，真の変化，非連続性を想定する」（Knight [1921]2006, 314／訳 391, 強調は原著者）と述べ，「ベルクソン的（すなわち，ヘラクレイトス的）意味における『真の変化』があるかぎり，理論付けが不可能であることは明白と思われる」（*ibid*., 209／訳 279）と指摘しているが，シュンペーターは経済発展論の集大成である『景気循環論』（1939 年）を指して，「ここには，創造的進化（évolution créatrice）のようなものが存在する」（Stolper 1994,

375）と述べ，ベルクソンの創造的進化に言及している．このように，ブラウワー（Brouwer 2002, 91）の結論とは異なり，革新は不確実性と表裏一体のものとして考えることができるのであり，シュンペーターはナイトの定義する意味での不確実性を無視しているわけではないことが分かるであろう．しかしながら，シュンペーターは革新を論じる際に，不確実性を前面に押し出して論じることをしなかったこともあり，結果的に不確実性が革新の 6 つの特質の陰に隠れてしまい，シュンペーターが必ずしも不確実性を無視していたわけではないということが見え難くなってしまったと思われる．

Ⅳ　分析の方法論

1．発生論的説明

シュンペーターは，発展のない場合と発展のある場合を区別している．そして，ある事象の分析をはじめるに当たってただちにその根源から出発する方法を，発生論的説明と呼ぶ．シュンペーターは，「発展を無発展の状態から生起させることにしよう」(Schumpeter [1912] 2006, 107)と述べ，発展のない状態に発展を導入するという分析方法を採用する．ナイトは，不確実性を分析するに当たって，不確実性のない場合と不確実性のある場合を区別し，不確実性のない状態に不確実性を導入するという分析方法を採用している．すなわち，不確実性の影響を考察するに当たって，「最善の方法は，不確実性がない社会を採り上げることで，次いで不確実性が導入されたとして，その構造にいかなる変化が起こるかを確かめようとすることである」（Knight [1921] 2006, 264／訳 338）と指摘する．この引用文にある「不確実性」を「発展」に置き換えて読むならば，それはそのままシュンペーターの『発展』の分析方法となる．このように，ナイトはシュンペーターと同じ方法論，すなわち発生論的説明という方法を採用していたということができるのである．

2．人間類型

シュンペーターは,『発展』で, 経済主体を 2 つの類型に分類している（Schumpeter [1912] 2006, 128）．これらは，経済主体の行動を基準とすることによって分類されており，それぞれの類型は，静態の理論と動態の理論に対応する．静態の理論に対応しているのが快楽的な行動の類型であり，動態の理論に対応しているのが精力的な行動の類型である．これらの人間類型は，論理厳密性を与えるための方法概念である．そして，シュンペーターの快楽的人間は受動的な経済主体であり，ナイトの分析における不確実性のない場合の合理的に行動する受動的な経済主体に対応しているということができるであろう．また，シュンペーターの精力的人間は, ナイトの分析における不確実性のある場合の能動的な経済主体, すなわちナイトの企業者に対応しているということができるであろう．というのも，ナイトの,「生産活動を組織し，社会に競争的な秩序をもたらす企業者はまた，経済発展を牽引する唯一の創造的主体でもある」（黒木 2001, 47）からである．

Ⅴ　企業者と利潤

1．企業者

シュンペーターとナイトは，企業者の役割に関する力点の置き方は違えども，企業者を中心に据えることによって利潤の発生を説明している. また, シュンペーターもナイトも，「生産者が，消費者の欲望を先見することの責任を引き受ける」（Knight [1921] 2006, 268／訳 341）と捉える．シュンペーターは，企業者機能はひとりの人間の中で永続するものとは考えず一時的に発現する機能とみなしている．そして，シュンペーターは,「われわれは企業者というものを，資本家，危険負担者，単なる技術的ないしは商業的経営指導者，および自己負担に立って活動する静態的経済主体からきっぱりと分離する」（Schumpeter [1912] 2006, 515-516）と指摘し，危険を負担するのは，企業者ではなく，信用供与者であるという．ナイトの企業者は，制度の中心人物であり（Knight [1921] 2006, xi／訳 3），2 つの特別な機能（function）を持つ．1 つ目は,「責任ある統御を果たすこと」（*ibid*., 278／訳 351）であるという．2 つ目は,「収入における不確実性と変動に対して，生産用役の所有者に保証すること」（*ibid*., 278／訳 351）であり,「この保証的機能は明らかに統御のそれと共にゆかざるを得ない」（*ibid*., 278／訳 351）．ゆえに，企業者自身が生産用役の所有者に対して所得を保証するだけの十分な担保能力を所有していない場合には，外部の誰かを説得し何らかの所得を支払うという条件のもとにその保証能力を引き受けてもらう必要がある.

2．利潤

シュンペーターは,「発展なしには企業者利潤はなく，企業者利潤なしには発展はない」（Schumpeter [1912] 2006, 322）と述べる．ナイトは,「もし，すべての変化が不変かつ斉一的な既知の法則に従って起こるものであれば，…利潤(または損失)は生じないであろう」（Knight [1921] 2006, 198／訳 268）と述べる．シュンペーターとナイトは，静態には利潤が存在しないという点で同じであり，かつ変化そのものが利潤の原因であると考えない点でも同じである．それゆえに，突き詰めて考えれば，最終的には，シュンペーターもナイトも不確実性が利潤を生むと考えていた点で同じであったと指摘することができるであろう．というのも，シュンペーターの利潤を生み出す革新が不確実性と表裏一体の関係にあり，ナイトは「利潤を発生させるところの『危険』は，評価することのできない，すなわちなんらの客観的な根拠に基づき分類できないような状況に結び付けられた不確実性である」（*ibid*., 310／訳 386）と指摘しているからである．また，シュンペーターは,「企業者利潤は事業経営における収入と支出との差額である」（Schumpeter [1912] 2006, 278）と指摘し，ナイトは,「企業者の収入は，固定されたものではなくて，固定収入が支払われた後に残るものすべてから成り立っている」（Knight [1921] 2006, 280／訳 353）と指摘している.

※参考文献表は当日配布いたします.