

主張点

- ・経済学が重視しているのは実証的リアリティよりも演繹的リアリティではないか。
- ・ラカトシュモデルの代替案としての科学の三層モデル
- ・三層モデルを前提として整理できる論点
- ・Jaspersen *Macroeconomic Methodology* についての考察

1. 経済学が重視してきた「リアリティ」とは

科学のモデルとしてよく言及されるラカトシュの protect-belt, hard-core からなる二重構造モデルは経済学史に照らしてみると、経済学の変遷の事情を説明するには適していないように思われる。というのは、実験による検証・反証と理論を対峙させた科学／非科学の線引き問題という文脈を引き継いで、ラカトシュモデルは「不都合な事実」に理論がいかに対処するのかを説明するには便利に作られているが、経済学史上の理論の根幹に関わるような深刻な論争は、実証データと理論の整合性をめぐってではなく、むしろ理論そのものの整合性・展開性を巡って行われてきたからである。

たとえば、現代の主流マクロ経済学を方向づけたと目される「ルーカス批判」について考えてみよう。もしも問題が純粹に、政策変更→人々の期待変更→行動変化→(集計の結果としての)マクロ変数間の関係変化という影響経路が考えられる以上、マクロ変数間の関係を政策とは独立なものとして政策効果を論じることはできないという点にあったのであれば、マクロ変数間の関係を示すパラメータに政策によって影響される項を追加するのが直截で自然な対応である。しかし実際に要求され支持されたことは、上のパスを取り扱う理論基盤を整備すべし、すなわちマイクロ・ファウンデーションの要求であった。もちろん、マクロ変数間の安定的な関係が観察されないのであれば、マクロ変数だけのモデルにとどめておくことはできない。マクロモデルのホワイトボックス化の要求はその意味では妥当なものといえる。しかしルーカス批判の意味を考えるうえで重要なのはその先に行われたことである。マクロ消費関数をホワイトボックス化するため、その基礎となるものとして個別家計の行動モデルとして最も簡単なのは、自らの手取り収入を見て消費行動を決める、定型的調整行動モデルではないだろうか。これは集計すれば容易にマクロ消費関数にまとめられるし、ケインズのテキストとも調和する。しかし実際には個別家計の鼓動モデルは期待形成モデルを付加した効用最大化モデルに置き換えられ、そこからマクロを組み上げる手順として市場均衡が採用されたのは、明らかに「それまでのマクロモデルをホワイトボックス化する」ということではなく、一般均衡理論に沿った別個のマクロモデル構築作業である。その後の多数派となったマクロ経済学はその延長線上に構築されていったのであるから、「マクロ経済学の新古典派化」は当然の帰結であった。

このルーカス批判をめぐる一連の動きの中で追求されたものは何だっただろうか。批判は従来型の IS-LM ベースの計量モデルが、政策発表に端を発する個々人の将来予測変更に伴う行動(パターン)変更を扱うことができていない点に向けられた。これは従来型計量モデルの予測能力の低下という実証的リアリティを問題にしているようでありながら、求められたものは最適化行動主体を前提とした市場均衡モデルと整合的なモデル展開によるマクロ経済モデルであった。

ではなぜそれが「多くの経済学者」に受け入れられたのかということ。「リアリティ」の観点から考えてみると、ベースとなる思考モデルと論理的に整合しており、かつ合理的期待形成モデルは論理的な親和性が高く、推論ステップの展開性も大きかったからではない

だろうか。

ラカトシュモデルは科学の核となる中心命題の反証不可能性（あるいは反証手続きの絶対的拒絶）を明示する。上の話で核に当たるものは、ベースとなる思考モデルである。経済学で典型的なものは、{最適化行動主体の意思決定が互いに整合的になる状態として社会を理解する}という思考法である¹。このベースとなる思考モデルと整合的に、演繹的推論のステップを積み重ねることで効果を増大する説得力のことを「演繹的リアリティ」と呼ぶことにしよう。すると、ルーカス批判を受けてのマクロ経済学の変容を進めた主たる原動力はこの演繹的リアリティの追求にあり、その結果としてこのベースの上に立つ純化されたマクロ経済学が現れたといえないだろうか。

経済学にあって現実のデータとの対応が問題とされる場合、それは理論モデルを基礎とした実証モデルに関して行われる。そのモデルとデータとの適合性に問題が生じるとき、まず対応を求められるのは実証モデルのパラメータ、より深刻な場合でお実証モデルのセッティングまでであって、その基礎となる理論モデルに改変が及ぶことは少ない。ましてや理論モデルのよってたつ基盤であるベースとなる思考モデルに及ぶことはない。

演繹的リアリティの追求は重視されるがゆえにそれをめぐる論争は大規模になりがちである。しかしながらベースとなる思考モデルを異にした論争は基本的に収束することがない。資本の取り扱いの背景に「商品による商品の生産」モデルをもつ議論と一般均衡理論ベースの上に putty-clay としての資本をおいた議論との間の論争は、理論モデルの演繹的リアリティに重大にかかわるがゆえに深刻化するが、防備帯と核の優先関係が、演繹的リアリティの追求と思考のベースモデルとの優先関係にあっても同様に適用されるため、ベースモデルに遡っての改変は行われぬ。利潤率が上昇するときに資本労働比率が低下するとはいえないという推論の帰結自体はきわめて明確であっても、論争そのものを記憶から消し去ることによって、何事もなかったかのように、集計的生産関数は多くの経済学者の推論の前提として生き続けているのである²。

2. 経済学を適切に理解するための科学の三層モデル

そこで話をもとに戻して、経済学で起こってきたことを理解するためにラカトシュモデルには何が足りないかを考えてみよう。上ではただ2例を挙げたにすぎないが、われわれが経済学史研究の中で目にする大規模な論争で、たとえそれがかみ合っていないなくても各論者によって追求されているものは、実証的リアリティよりも演繹的リアリティである。ラカトシュモデルではこうした経済学そのものを変容させるような論争を適切に取り扱うことができないので、これを拡張したいのだが、そのためにまず、そもそも経済学というものはどのように創られるのかという次のようなモデルストーリーを考える³。

研究者が経済社会の振る舞いを理解するための理論体系を創ろうとするとき、対象となるべき社会を観察することから始めるだろうが、機械や生物が研究対象である場合と違って、どういう観点から社会を何を見るのか、そもそも社会とは何なのか、ということが観察対象の振る舞いや存在に関して、より問題となる。このような研究者の観察に先立つ「関心」は、研究者自身の経験、研究者の時代の思想・文献との接触から独立ではないし、観察の作業の中からも醸成されていく。そして対象となる社会の様々な属性が観察されていくわけだが、このような過程を経て認識された社会の属性の中から、社会を1つのシステムとして捉えるための足場となるような属性（基本的属性）が見いだされると、社会は基本的にどのようなものであるのかという「基本了解」が確定する。ここまでのプロセスを最基

底層の構築過程と呼ぶことにする。

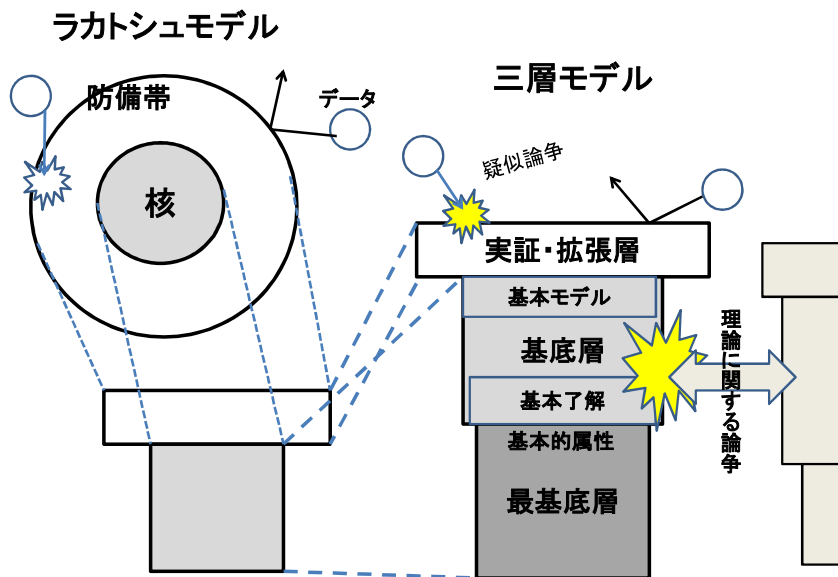
最基底層の構築に続くプロセスは、基本了解を他者に明確かつ効果的に伝えるための表現技法を選択し、追加的な前提、補助モデルを付加して、基本モデルを構築する作業である。表現技法は、経済学の場合は解析的な数理モデルが選択されることが多いが、基本了解を効果的に他者に伝えることができるものであればよいので、計算論的な数理モデルであっても構わない。いずれにせよ、基本了解を前提にした論理的な整合性が最重視される。このプロセスを基底層の構築過程と呼ぶことにする。

基底層の構築に続くプロセスでは、基本モデルの現実適用範囲を広げるアプリケーションモデルの開発や社会のデータへの接地を行う実証モデルの開発が行われる。基本モデルは基本的属性をベースに作られているので、捨象された非基本的属性を扱うことができない。したがって、他者に対する説得力を増すためには、もし可能であれば限定的であっても非基本的属性を扱おうようなモデルの拡張が行われることが必要になる⁴。その一方で基本モデルの主張を数量的に把握し、場合によっては政策として対象社会に関与できるようになるためには実証モデルが整備されなければならない。自然科学における実験に対比されるべきものは、実証モデルのパラメータ推計や検証の作業である。これは適切な手続きを経て得られた経済データから帰納的に実証モデルのパラメータを推計するという意味で「経験的」作業であるが、最基底層の関心の背景となっている経験（端的な経験）とは区別されなければならない。このプロセスを実証・拡張層の構築過程と呼ぶことにする。

では以上のモデルストーリーを踏まえた上で、経済学の状況を整理し理解するための科学モデルとして、次のような最基底層・基底層・拡張&実証層からなる三層モデルを提案したい。

ラカトシュモデルをいわば横から見たこのモデルにおいても、最基底層→基底層→拡張&

実証層という順で前者が後者を規定し、後ろの層におけるイベントが前の層の仕様を修正することはない点は、核→防備帯の規定関係を継承している。先のストーリーの繰り返しになるが説明しよう。まず、最基底層では、経済社会をどのような属性に注目すれば体系的に捉えることができるのか、研究



者に影響を与える研究史や生活経験など創始研究者の環境、対象観察と研究者の関心の往復の過程から、基本了解が確定される。これはアブダクション主導の過程である。その上の、基底層では、最基底層で確定された経済社会の基本属性をもとにして基本モデルが構築される。その際、表現に適した表現技術が選択され、その経済理論の基本仕様が固められる。この過程を主導するのは演繹的推論である。最後に、拡張&実証層では、基本モデルで捨象されていた対象の属性が基本モデル仕様に抵触しない限りにおいてモデルに追加導入（拡張モデル）される一方、データ整備とともにデータ接地型モデル（実証モデル）の開発が行われる。後者はコントロールされた実証研究を可能にするが、この層における

「経験的データ」と最基底層における「端的な経験」を同列に扱うことはできない。この層においてはじめて実験という形での帰納的推論が前面に出る。

3. 三層モデルを念頭に置くことによる論点整理

このような「科学モデル」を念頭に置くと、理論や方法の評価にまつわる議論を整理することができるのではないだろうか。

理論変化の評価、冒頭に見たルーカス批判はマクロ経済学において、一般均衡理論を基本モデルとするときに、基底層を純化させ、実証層の計量モデルもそれに対応するものにしたという点において、一般均衡理論ベースの経済学内部でみれば経済学の演繹的リアリティを向上させたことになるが、一般均衡ベースではない経済学を構想する学派にとっては退化として映るのは当然である。もともと一般均衡理論そのものに疑義を抱いていた研究者にとって、疑念自体を不問に付された上に合理的期待形成モデルまで追加されてしまっただけでは共感しようがないであろうし、有効需要の原理のマイクロ・ファウンデーションを模索していた研究者にとって、解くべき課題もないところでマイクロ・ファウンデーションといわれても困惑するであろうからである。

また、概念の扱い方の評価、たとえば限定合理性の扱い方の評価の場合、合理的主体+ナッシュ均衡ベースの基底層を持つ経済学では、制約条件の一部を認識しない主体モデルの導入は拡張モデルとして高評価されるが、そもそも主体の在り方として限定合理性を基礎に置く研究者からみればそれは不満足な扱いとしてしか映らない。アプリケーションモデルは非基本的属性の取扱いができるような理論的拡張を可能にするものではあるが、それはそのよってたつ経済学の基本理解に抵触しない限りにおいてのことである。すべての主体が短く限られたステップで推論を行うことで自らの努力に「満足」するのであれば、演繹的リアリティを追求すればするほど、限定合理性の取り扱いの不十分さは際立つことにならざるを得ない。

さらに、研究手法の評価、たとえばシミュレーションの評価は研究者によって大きく異なる点がある。しかし、最基底層・基底層・拡張&実証層のどの構築プロセスでシミュレーションが用いられるかによって評価すべきポイントは変えなければならない。シミュレーションモデルは、システムの振る舞いについて見通しが立っていても構築できる自由さがあるため、対象システムについて発見を期待することができるという強みの一方で、初期値依存が高いために結果がアドホックになりがちという弱みを持っている。したがってシミュレーションは、最基底層での社会の各属性の意味するところを明らかにするための思考実験、基底層での基本モデルの含意チェックなど、基本モデルが確固としたものになっていない基盤層における議論になるほど発見的效果をもつが、拡張・実証層で同じような用い方をしていたのでは、基本モデルの脆弱さを表明するようなことになってしまう。拡張・実証層で用いる場合は、明確に定義された拡張モデルに立った上で、ありうる初期値を広くカバーすることによって結果の恣意性を抑えることがより必要になる。それに加え、シミュレーションモデルは動作するか否かが明白に結果として出てくるため、エージェントの実装条件とシステムの動作について具体的な考察ができる点は、とくに実証層にあっては利点となる。このようにシミュレーションをどの層のどのような問題に対して用いるのかを絞ることによって、評価の不要な祖語は避けられるはずである。

さいごに、三層モデルによる具体的な議論整理事例として、J. Jespersen の Macroeconomic Methodology によるポストケインジアンと新古典派の対比のフレームワークの妥当性を検討しておこう。Jespersen は完全市場の働きを分析することを第一義とし、公理からの演繹によってのみ展開する一般均衡理論と、世界1のオントロジーを理論のランドスケープと

して写像し、それをもとにした理論を歴史によってテストして得られたものから、世界3の政策立案へとつなぐものとしてみたポストケインジアン⁵を対比して、ポストケインジアンの方法的優位を強調する。けれどもこれは一般均衡理論側には不当な評価といわざるをえない。基本モデル確定後の層の演繹的リアリティ、実証的リアリティの充実に関して一般均衡理論を評価することないのは公平さを欠くことになるし、ポストケインジアンの理論が世界の在り方を反映し、歴史の経験との往復によって検証されるというのも、最基底層か基底層かによって意味するところが異なる。基本モデルが必ずしも確定していない点は演繹的リアリティの充実という観点からすれば弱点であるからである。やはり、異なる研究計画の対比にあっては、それぞれの科学層の性質を明らかにしたうえで、対応する各科学層に関して評価していくことが必要となる。

4. まとめ

経済学で起こってきたことを適切に理解するための科学の三層モデルを導入することによって、少なくとも経済学の方法に関して論点整理ができるのではないだろうかと報告者は考える。各層を主導する推論原理が異なるのであれば、演繹と帰納という大きな方法論上の問題点についても何かしらの整理ができるのではないかとも思うが、これは慎重な別個の考察が必要なことである。経済学史研究は、理論・学派の生成、学派が確立したのちに起こってきた大論争、理論の展開といった、きわめて広いレンジで経済学を捉え考察するという課題を抱えているがゆえに、より適切な科学モデルを持つべきではないだろうか。

¹ このように書くと、「それは藁人形にすぎない」という反応が予想できるが、主体行動モデルとして制約条件下の効用関数最大化、そうした主体によって構成されるべき社会モデルの構築の必要条件としての市場均衡、あるいは、ナッシュ均衡、という手順から完全に独立な一暗黙にすら前提としない一主流の経済学というのは考えにくいのではないだろうか。

² 資本論争のコンパクトな解説としては、高増明「ピエロ・スラッファ」(大森郁夫編『経済学の古典的世界2』(『経済思想第5巻』)第7章 pp.341-335、日本経済評論社 2005) 参照。

³ 西部・吉田編集代表『進化経済学基礎』(日本経済評論社、2010) 第1章参照。

⁴ それが活発に行われているとき、その経済学は「前進的なプログラム」ということになるだろうが、何をもって「活発」とみなすかはベースとなる思考モデルが異なれば評価も変わるだろうから、異なる「経済学」を比べる際の参考程度にしかならない。

⁵ Jaspersen *Macroeconomic Methodology*, p.54 fig.2.1 参照。