

マクロ動学分析の方法

関根, 順一
九州産業大学経済学部

<https://doi.org/10.15017/4493101>

出版情報：経済學研究. 59 (5/6), pp.165-171, 1994-06-10. 九州大学経済学会
バージョン：
権利関係：



マクロ動学分析の方法

関 根 順 一

1 はじめに

理論経済学者は、通常、限定された特定の問題の興味を持っており、理論経済学の理論体系全般やそれを支えている方法論的基礎について思い巡らすことはまれである。どの経済問題にも普遍的に適用できる分析方法について論じることなど、ある特定の問題に注意を集中している者には、余計な回り道としか思われまいだろう。しかしながら、いくつかの理論問題を深く徹底的に研究したことのある者なら、それらの問題の解明に際して、しばしば共通の困難にぶつかった経験を持っているに違いない。そうした共通の経験のうちの一部は、方法論的問題に関わっている。

理論経済学の固有な困難は、経済現象の基本的な原因を特定することの難しさにある。我々が日々接している経済現象は、実に種々雑多な原因によって引き起こされる。これらの多くの原因の中で、広範な妥当性を持った原因はどれなのか。経済現象が日常的である反面、その基本的な原因を突き止める作業は非常に難しいものとなる。

本稿では、そのような固有の困難に対応する指針について述べる。特に、理論の階層化、理論体系の構築が固有の困難を克服する上で有効

であることを主張する。さらに、理論の階層化への正しい理解は、理論的抽象度への配慮が欠如していることから起こる不毛な議論を予防することにもなる。

2 理論の必要条件

社会科学に限らず、一般に科学的議論が満たすべき条件は以下の三つである。

第一に、論理的記述であること、二つの現象aとbの間に論理的関係が成立していれば、現象aが発生する時、必ず現象bが引き起こされる。この時、現象aは、現象bの要因になる。現象bを引き起こすすべての要因が明らかになれば、原因が究明されたという。

第二に、研究対象となる現象bは、ある程度の抽象性を持つこと。一般に科学は、ただ一回しか起こらない現象それ自体を研究対象にしているのではない。そうではなく、厳密には、いくつかの現象のある共通な諸性質を研究対象として設定しているのである。だから、科学的な理論の分析対象は、現象それ自体ではなく、実際には、言葉によって記述される抽象的な概念ということになる¹⁾。個別具体的な現象の中か

1) 我々は過去の個別の現象の究明自体を目的にしているのではけっしてない。人々が過去の現象に興味を持つのは、未来に同種の現象が発生しうるとす

ら、ある共通の性質に注目して理論研究の対象を指定することも、すでに理論をつくる作業の一環である。このように、理論の対象は現実の諸現象のある共通な諸性質であるが、逆に、具体的な現象はこれらの抽象的な諸概念の共通部分になっている。

第三に、要因 a またはその集合 A は、現象 b と同程度の抽象性を持つことが望ましい。原因は、説明される対象と比べて過度に抽象的であってはならない。その場合、原因の記述は簡潔になるが、結果との関係は不明瞭なものとなろう。反対に、原因は、結果と比べて過度に具体的であってはならない。その場合、原因の記述は複雑で冗長なものとなろう。

第三の条件は、理論の形式に対する要求であり、一種の審美的な基準である。上述の第一条件、第二条件を満たすにもかかわらず、この審美的基準を満たしていなければ、その理論は不完全なものと見なされ、さらに完成度の高い理論が追求されるだろう。

審美的基準と言ってしまうえば、論理の形式を整えるだけの条件のように聞こえるが、そうとばかりは言えない。理論研究は、単に原因を知りたいという観照的な欲求から行われているのではない。個人個人の研究者によって意識されているかどうかは別として、一般に、理論は実践のための手段である。理論を実践的な要求によりよく適合させるよう課せられた条件が、理論の第三条件なのである。すなわち、実践的必要から生まれた問題には、実践的見地から有意義な答えが求められる。

れば、その原因についても事前に知っておきたいからである。原因がわかれば、好ましくない現象についてはそれを未然に防ぐこともできよう。我々の一般的知識への欲求は、このような実践的な必要性からきている。

すでに述べたように、理論研究の対象が抽象的な概念である以上、当然、具体的個別的現象はその一部分しか考慮されていない。では、理論の展開過程で考慮されずに、切り捨てられた部分はどこに処置すればよいのか。残余部分については、すでに完成された理論を所与にして、新たに理論的对象を再構成し、既存の理論より下位に位置する新しい理論を作ってやればよい。こうして、諸理論間の階層的な構造が、すなわち理論体系が生まれるのである。

3 社会科学における因果性の問題

社会科学においても、前節で述べた三つの条件を満たす理論、あるいは理論体系をつくることができる。もっとも、科学の各分野には、その分野固有の困難がある。それ固有の困難がどのようなものであるのかを自覚しておくことは、社会科学の独自性への認識を大いに高めるだろう。

社会科学の特徴は、現象とそれを引き起こす諸要因の関係が必ずしも単純ではない点にある²⁾。このことを少し詳しくみておこう。

一つの現象に対して常に一つの要因が対応していることはまれである。むしろ、一つの現象は普通、複数以上の要因によって引き起こされる。たとえば、コーヒーの価格を決定しているものは、コーヒーに対する消費者の選好、コーヒー豆の生産条件、耕作地にかかる地代、紅茶などのコーヒーの代替品の価格等々である。逆に、一つの要因が複数以上の現象に関係している場合もある。たとえば、ある種の農業技術の

2) 似たような問題意識に立った研究には、Hicks [6] がある。同書では、時間構造との関連で因果性が論じられている。

革新は、コーヒーの価格だけではなく、紅茶の価格にも影響を与えるだろう。

さらに複雑なことに、原因と結果が容易に判別できない場合もある。ある時点においては、現象aが現象bの原因になっているように見えるが、別の時点では、反対に現象bが現象aの原因になっているように思われる場合がそうである。経済学におけるその典型例は「クモの巣の循環」(cobweb cycle)であろう。そこでは、前期の取引量が今期の市場価格を決め、今期の市場価格がさらに次期の取引量を決定する。取引量と市場価格はそれぞれ交互に原因となり、結果となる。経験的には、二つの現象の時間的前後関係が直接に両者の因果関係を決めているように言われるが、この場合には、そのような経験則は通用しない。

また、原因を構成する複数の諸要因には種々の性質の相違がある。第一に、恒常的に作用している要因と並んで、各時点で一時的にしか働かないような要因がある。たとえば、コーヒー豆への投機的需要などは一時的要因のよい例であろう。将来のコーヒー豆の価格上昇が予想されれば、しばらくコーヒー豆の需要は急増するだろうが、価格がある程度まで上がってしまうと、増加したコーヒー豆の需要は今度は急速に収縮するに違いない。

本質的な要因と従属的な要因を区別することは一層重要である。一つの現象bに対して、二つの要因,cとdがある時、要因dが働くためには、まえもって要因cの存在が前提されていなければならないとしたら、言い換えれば、要因cなしには要因dが作用しないとしたら、要因cが本質的な要因であり、要因dは従属的な要因である。相対価格がどのように決まるのかという問題は、相対価格の存在を、それゆえ、商

品生産の存在を前提している。だから、相対価格を決定する要因は、それがどのようなものであれ、商品生産を存続させる諸要因が成立する限りで、その成立の範囲でしか有効性を持たない。前者の要因は、後者の要因に対して従属的である。

第三に、客体的要因と主体的要因が区別されなければならない。それ以前の社会的諸現象の必然的帰結として機能している客体的要因と、社会的変化を引き起こした諸要因そのものに対して何らかの変更を迫る主体的な要因との区別である。技術革新と時としてそれに付随する金融制度改革は、実質賃金率上昇等の客体的な要因に対峙する主体的要因の一例である。

個々の具体的経済現象の分析は、経験的、論理的に考えられる種々の要因の性格づけから始まる。その上で、まず、恒常的な要因、本質的な要因、客体的な要因に目が向けられるべきである。すでに述べたように、この時の考察対象は、もともとの社会現象そのものではなく、その一部の性質のみを取り出した抽象的な対象であった。だから、問題は一層抽象的なものに再構成されている³⁾。続いて、必要に応じて、それまで考慮されていなかった一時的な要因や従属的な要因が順次段階的に取り込まれ、理論の階層化が進められ、理論体系が構築されていく。このように社会科学においてこそ、より強い理由で、理論体系が必要とされるのである。

諸要因の性格と理論体系上のレベルへの配慮の有無は、分析の科学性の判定条件である。外挿法(extrapolation)による将来予想は、このような配慮をまったく欠いたものである。外挿法では、現在作用している全ての要因がまった

3) Marx [9] 第一分冊, 第一版序文 p 22

く同列で評価され、それらの要因の性格の違いはまったく無視される。その結果得られるのは、一時的な要因、付属的な要因の過大評価である。このような研究方法は、経験主義的であり、それゆえ非科学的である。

また、日常的でなじみ深いという単純な理由だけで、既存の基本モデルに新しい要因を付け加えるという安易な研究態度も、諸要因の性格と理論体系上のレベルへの配慮をまったく欠いたものである。通常、新しい本質的でない要因を他の本質的な要因と同列に取り扱えば、モデルの因果関係は複雑になり不明瞭になる。したがって、安易に拡張されたモデルは一般に、理論の第三条件を満たさなくなるだろう。

理論の階層化とともに社会科学研究の強力な手段になっているのが、モデルの構築 (model building) である。前述の通り、社会科学固有の困難は、しばしば複数の社会現象が複数の要因と結びついている点にある。このような場合、それらの要素をすべて含むモデルをつくることは、非常に有効である⁴⁾。では、モデル分析における考察対象の諸要因とは何か。また、それらはどのように性格づけられるのか。

モデルは同一の経済変数の時間的な前後関係を記述している場合、動学モデルと呼ばれる。動学モデルは、これも前述した原因と結果の相互転換が見られる状況に対応している。動学モデルでは、二つの変数またはその組み合わせが、時間的に前になったり、後になったりすることがあるが、そのどちらも一時的要因であり、モデル全体を構成している要因ではない。もはや、時間的な遅れ (time lag) が無視できる状態で、別な言い方をすれば、いくら時間がたってもこ

れ以上変化がみられないような状態で、その状態を決定している要因が、モデルそのものを構成している本質的な要因なのである。我々は、まずこの要因に注目しなければならない。

本質的な要因の分析を出発点としている以上、我々の考察は、社会全体に関する分析から始めなければならない。そうしなければ、常に社会全体についての特定の理論をあらかじめ前提することになり、そのような分析は従属的なものになるだろう。

だが、社会全体についての経済分析 (macroeconomic analysis) から始めなければならないという要請は、さらに別の研究上の困難をつけ加える。というのは、我々の日常的な経験は、例外なく社会全体に比べて部分的であり、かつ、そのような日常的な経験を無批判に社会全体に延長することはできないからである⁵⁾。日々の常識や社会通念は、それを社会全体に適用してもやはり妥当なのか。そうでないとすれば、どのような条件のもとで妥当性を持つのか。科学的立場を守ろうとすれば、このような吟味は不可欠である。

4 資本制経済の基本的特徴

現代先進工業諸国の主要な経済現象の恒常的で本質的な要因は何であろうか。Marx 以降の多くの研究は、19世紀以後の西ヨーロッパ、北アメリカ、日本の経済がつぎの三つの制度的要因によって特徴づけられることを明らかにした。

第一に、階級社会であること。すなわち、生産手段の所有者と非所有者が存在する。生産手段の所有者は生産手段の利用に関する主要な決

4) モデルが数学的に表現されるかどうかは二次的な問題である。

5) たとえば、Marx [9] 第三分冊, p 230

定権を握っている。生産手段の所有者の集団は資本家階級と呼ばれ、非所有者の集団は労働者階級と呼ばれる。

第二に、商品生産社会であること。生産手段は、各資本家によって分散的に所有されている。別の言い方をすれば、生産手段は資本家階級の共有ではない。

第三に、労働市場が成立していること。労働に対する超過需要に応じて、実質賃金率は、上昇または下落する。したがって、労働者の所得は、ある一定の範囲で変動する可能性がある。

以上の三つの基本的な特徴を持つ社会を資本制経済という。三つの制度的基礎はいずれも、人類社会の一定の生産力を前提に成立しており、その意味で歴史的な条件である⁶⁾。

現代先進工業諸国の経済問題を考える時、我々は資本制経済の基本的特徴を分析の出発点とする。その理由は、それこそが今日の主要な経済諸現象の恒常的で本質的な要因であるからである。実際には、上で示した資本制経済の基本的特徴が個別の経済現象の恒常的で本質的な要因であるかどうかは、一つ一つ吟味されなければならないことである⁷⁾のだが、我々はその議論を繰り返すつもりはない。長い分析の末にどのようにして本質的な要因にたどりついたのかを回顧するよりも、本質的な諸要因を含む種々の要因がどのようにして解明すべき現象に結びついているのかを示す方が、はるかに簡明であり、また、実り多いからである。

周知の通り、理論経済学者の大半が現代経済のこのような特徴づけに賛成しているわけではない。特に新古典派の経済学者は、基本的特徴

の第一点を決して認めることはない。新古典派によれば、現代経済は生産要素市場を有する商品生産社会である。各種の生産要素を種々の異なる割合で所有する諸個人が、生産した財を市場で交換する小商品生産社会、新古典派の言葉で言えば、市場経済である⁸⁾。

現代経済を単なる市場経済としてしか把握していないことは、新古典派の問題意識を著しく狭めてしまっている。彼らの主要な関心は、主として価格の決定問題に集約される。実際、初期状態で諸個人間の資源配分に顕著な差がない以上、諸個人を類別することは無意味であり、所得配分は重要な問題になりえない。完全競争、不完全競争、情報の不完全性等の状況下で価格がどのように決定されるのかが研究され、決定された資源配分について、その効率性や社会厚生が検討される。市場メカニズムが効率的かどうかは彼らの問題意識の中心である。

現代社会を階級社会と認識しないことは、重大な理論的問題を引き起こす。たとえば、企業概念があいまいであること⁹⁾、特に企業利潤が長期的に0であること、労働市場の成立に必然性がないこと、等々である。そしてなによりも、問題意識の貧困である。

各人の自由な選択や行動が市場経済の一つの利点であると考えられているから、選択行動の定式化が新古典派ではとりわけ重視される。現代的な言い方をすれば、ミクロ的基礎づけ (microfoundation) が要求される¹⁰⁾。

なるほど、資本制経済は商品生産社会であるから、一般論としては、この要請は正当なもの

6) 置塩 [13] p 26-30

7) たとえば、新野-置塩 [12] p 165-169にはこの点に関する優れた分析がある。

8) Lange [7] p 192, Harcourt [2] p 2

9) このことは、金融的資本の保有者と資本設備の所有者の混同につながっている。

10) Blanchard and Fischer [1] p 27

である。しかしながら、資本制経済での人々の選択行動は、一般に一定の範囲に、資本制経済の成立の範囲に限定される。日常的には人々はかなり自由に行動しているように見える。特に、人々は非常に多くの種類の消費財の中から自分の好きなものを自由に選択し、消費している。だが、社会全体からみれば、決して勝手気ままに行動しているわけでない¹¹⁾。一般に、人々の選択範囲は、資本制経済の成立条件を逸脱することはない。特に、生産に関する基本的な決定から排除された労働者にとって、今日着る服を選ぶ自由はあっても、彼らが勤務している企業の産出量、雇用、技術選択等に関する決定を行う自由はない。ある日、突然予告もなく職を失うことさえ十分ありうるのだ。

選択とは、実行可能な選択範囲の中から、欲求を最もよく満たすような対象を見つけることである。言い換えれば、実行可能性集合の中から、目的関数の値を最大にするような変数または変数の組合せを探すことである。ところで、人々の選択範囲が狭くなれば、選択を行ったかどうかの結果に及ぼす影響はますます小さなものとなる。人々がより狭い範囲の中から選択するようになれば、どのような選択を行ったとしても、あるいは選択を行わなかったとしても最適解はそう大きく違わなくなるだろう。だから、選択行動の重要性は、選択範囲の広さとの関係で相対的に評価されなければならない。

社会全体について考える時にも、人々の行動の制約条件がどのようなものかをまず具体的に明らかにする必要がある。その上で、その制約条件との関連で、人々のそれぞれの選択行為の理論的重要性が評価される。だから、無条件に

どんな場合でも選択行動を考慮すべきだということにはならない。

社会が自由意思を持った諸個人の集合体であるとすれば、そのような自由な個人の行動の結果が、各個人を苦しめているのは一見大きな矛盾であるように思われる。しかし、「矛盾」の存在を無視するのではなく、その「矛盾」がなぜ発生するのかを合理的に説明することが、まさしく社会科学の課題である。もし、人々が物理的制約条件以外、他の一切の社会的、歴史的制約に服していないと先験的に前提してしまうと、この難問は永久に解けないことになる。

5 長期経済分析の重要性

資本制経済の基本的特徴は、我々の経済分析の基礎であり、公準である。だから、理論モデルの仮定は、この資本制経済の基本的特徴と整合的でなければならない。もちろん、資本制経済の基本的特徴と矛盾するような状況が現実にはありうるかもしれないが、それはまず第一に取り扱うべき基本理論の対象ではない。また、資本制経済の基本的特徴は、他の理論モデルを評価する際に、その仮定や結論に対する評価の基準としても役に立つ。資本制経済の基本的特徴と矛盾するような仮定を持つ理論は、現代経済分析にとって二次的である。

資本制経済の基本理論とは、資本制経済の基本的特徴と直接に結びつく要因およびその結果から構成される理論である。だから、一時的にしか作用しない要因は完全に捨象される。経済諸変数の時間的な遅れ (time lag) や市場の調整過程が引き起こす諸現象は取り扱わない。第二に、主として客体的な要因に注意を集中する。結局、基本理論は、資本制経済の基本的特徴に

11) これは、前節で述べた社会の局所的性質をただちに社会全体に拡張できない例である。

ついで本質的で恒常的な要因によって構成される。

基本理論を長期理論と言い換えてもかまわない。というのは、長期においては、近似的には、一時的な要因、攪乱的な要因は相殺されて、より本質的で恒常的な要因のみが作用するだろうからである。我々はまず、長期的に成立する経済諸変数間の諸関係について研究する。その研究成果の基礎の上に、順次、一時的な要因や従属的な要因を包含することによって、より短期的な分析に向かうだろう。研究が進められ、理論体系が作られていく方向は、明確に「長期から短期へ」である。

参 考 文 献

- [1] Blanchard, O. J. and S. Fischer, *Lectures on Macroeconomics*, (Cambridge, Mass., MIT Press, 1989)
- [2] Harcourt, G. C. *Some Cambridge Controversies in the Theory of Capital*, (Cambridge, Cambridge University Press, 1972)
- [3] Harrod, R. F., 'An Essay in Dynamic Theory,' *Economic Journal*, Vol. 49, 1939, pp. 14-33.
- [4] Harrod, R. F., *Towards a Dynamic Economics*, (London, Macmillan, 1948)
- [5] Hicks, J. R., *Value and Capital* 2nd ed. (Oxford, Clarendon Press, 1946)
- [6] Hicks, J. R., *Causality in Economics* (Oxford, Basil Blackwell, 1979)
- [7] Lange, O., 'Marxian Economics and Modern Economic Theory,' *Review of Economic Studies*, Vol. 2, 1935, pp. 189-201
- [8] Marx K., 「序説」『経済学批判要綱』, 高木幸二郎監訳 (大月書店, 1958)
- [9] Marx K., 『資本論』第一巻, 岡崎次郎訳 (国民文庫, 大月書店 1972)
- [10] Marx K., 『資本論』第二巻, 岡崎次郎訳 (国民文庫, 大月書店 1972)
- [11] Marx K., 『資本論』第三巻, 岡崎次郎訳 (国民文庫, 大月書店 1972)
- [12] 新野幸次郎, 置塩信雄, 『ケインズ経済学』, (三一書房, 1957)
- [13] 置塩信雄, 『蓄積論』, (筑摩書房, 1976)
- [14] Robinson, J., 'The Organic Composition of Capital,' *Kyklos*, Vol. 31 1978, pp. 5-20

(九州産業大学経済学部)