

© 2017

Григорий Дегтярев

доктор экономических наук, зам. руководителя
Департамента стратегического развития
Фонда социального страхования Российской Федерации
(e-mail: dgp48@yandex.ru)

Андрей Дегтярев

кандидат экономических наук, ведущий научный сотрудник
Института экономики РАН

ИДЕЯ РАЦИОНАЛЬНОСТИ

На основе анализа основных теоретических взглядов, положений и суждений о рациональности различных научных школ и направлений дается обоснование идеи рационализации, ее роли в эволюционном развитии как длительном, постепенном и последовательном процессе рационализации социально-экономических отношений. Критически осмысливаются и систематизируются различные формализованные представления о проявлениях рациональности и иррациональности в экономическом поведении индивидов.

Ключевые слова: рациональности, иррациональность, экономическое поведение, оценки внешнего наблюдателя, «нормативные требования», экономические механизмы.

Экономическое поведение: рациональность vs иррациональность. Проблемы рациональности и иррациональности человеческой деятельности, проявляемых при экономическом поведении индивида и принятии им решения как при индивидуальном выборе из множества возможных альтернатив, так и в процессе взаимодействия с другими индивидами, имеют давнюю историю и широко обсуждаются.

В фундаментальной работе Людвиг фон Мизеса, основателя неоавстрийской школы экономической теории, дан детальный анализ составляющих человеческой деятельности. Мизес высказывает радикально резкое суждение, что «человеческая деятельность всегда необходимо рациональна. Понятие рациональная деятельность избыточно и в качестве такового должно быть отброшено. В приложении к конечным целям деятельности понятия рациональный и иррациональный неуместны и бессмысленны»¹.

Данное суждение об избыточности понятия «рациональная деятельность» является следствием критического отношения к тому, что в процессе деятельности конкретного человека оценку рациональности, нерациональности, иррациональности его действий дает некто другой.

¹ Мизес Л. Фон. Человеческая деятельность: трактат по экономической теории / Челябинск: Социум. 2005. С. 22.

Отмечается, что если «такое поведение оценивается как иррациональное или ограниченно рациональное, то это означает лишь, что подобная оценка получена из *внешнего источника*, с позиций которого люди выбрали не самый лучший вариант в силу ряда обстоятельств, в том числе из-за мериторных дефицитов знаний, воли и ресурсов»¹.

Уместна и корректна ли такая оценка, производимая внешним источником, который не знает, не может знать, а может лишь предполагать мотивы, побудившие человека действовать? Только сам человек, принявший решение, может проанализировать и переоценить принятое им решение на основании *a posteriori* полученной информации.

Согласно Мизесу, конечная цель деятельности состоит в удовлетворении определенных желаний действующего человека. Поскольку никто не в состоянии заменить свои собственные субъективные оценки субъективными оценками действующего субъекта, «бессмысленно распространять свои суждения на цели и желания других людей. Никто не имеет права объявлять, что сделает другого человека счастливее»².

С точки зрения обыденных представлений и оценочных суждений «иррациональной» обычно называют деятельность, если она направлена на достижение «идеального» или «высшего» удовлетворения в ущерб материальным и осязаемым выгодам. ... Однако стремление к подобным высшим целям не более и не менее рационально или иррационально, чем стремление к другим человеческим целям. Ошибочно полагать, что удовлетворение первичных жизненных потребностей более рационально, естественно или оправданно, чем стремление к другим вещам и удовольствиям»³.

По мнению Мизеса, превращение человеческой деятельности и сотрудничества в объект науки *взамен нормативного описания* имело огромные последствия для познания социально-экономических процессов. Любое решение человека суть выбор, который «затрагивает все человеческие ценности»⁴. Цели и средства, материальное и идеальное, высокое и низкое, благородное и подлое, анализируются, приводятся в некую систему ранжирования и предпочтений человеком, принимающим решение.

Но человек не наделен способностями всеведения: «наше незнание безгранично и отрезвляюще»⁵. Теории исправляются и сменяются новыми теориями. Текущее состояние научного знания, науки вселяет некоторую относительную, субъективную, релятивистскую уверенность, но

¹ Рубинштейн А. Я. Теория опекаемых благ и патернализм в экономических теориях: общее и особенное / М. Институт экономики РАН. 2015. С. 13.

² Мизес Л. Фон. Человеческая деятельность: трактат по экономической теории / Челябинск: Социум. 2005. С. 22.

³ Там же.

⁴ Там же. С. 7.

⁵ Эволюционная эпистемология и логика социальных наук: Карл Поппер и его критики / Составление Д. Лахути, В. Садовского и В. Финна // М: Эдиториал УРСС. 2000. С. 200.

не абсолютную и окончательную определенность. Научная система лишь «полустанок на бесконечном пути поиска знаний»¹.

Справедливо отмечается, что слова Карла Поппера звучат «отрезвляюще» по отношению к исходным допущениям большинства моделей человеческого поведения в экономике, «в том числе, к постулату рациональности»².

Предпринимаются попытки ревизии, уточнения постулата рациональности, принципа рационального экономического поведения, способностей и возможностей индивида делать рациональный выбор.

Задан резонный вопрос: «Поведенческая экономика: экзотика или наука?»³. В целях уяснения и понимания перспектив и рамок «нового аналитического направления, за которым закрепилось название поведенческой (бихевиористской) экономики (behavioral economics), и по праву считающимся «одним из наиболее интересных и примечательных событий в развитии экономической науки последних десятилетий»⁴, представим краткий анализ его истоков и оснований.

Считается, что понятие «экономическая психология» было предложено Габриэлем Тардом, известным французским социологом и криминологом, одним из основателей субъективно-психологического направления в западной социологии. Идеи экономической социологии были изложены Тардом в 1881 г. в статье, а затем в двухтомной работе «La Psychologie Économique»⁵, вышедшей в 1902 г. По мнению Г. Тарда, экономическая психология должна стать новой наукой, опирающейся на научные достижения психологии. Г. Тард критиковал экономистов за то, что человек не рассматривается как социальное существо. По его мнению, не индивидуализм, а взаимодействие людей должно стать основой науки об экономическом поведении. Он предложил разрабатывать экономические модели, учитывающие психологические предпосылки.

Экономисты периодически постулировали как проверенные опытом психологические законы. Так, Дж. М. Кейнс сформулировал основной психологический закон, который, по его мнению, выражает реальные отношения, возникающие в жизни. Он отметил, что по мере увеличения доходов, которые направляются на личное потребление, большая их часть

¹ Мизес Л. фон. Человеческая деятельность: трактат по экономической теории / Челябинск: Социум. 2005. С. 12.

² Рубинштейн А. Я. Теория опекаемых благ и патернализм в экономических теориях: общее и особенное / М. Институт экономики РАН. 2015. С. 8.

³ Дрогобыцкий И. Н. Поведенческая экономика: экзотика или наука? / Мир новой экономики. М. 2016. № 3.

⁴ Капелюшников Р. И. Поведенческая экономика и новый патернализм // <http://polit.ru/article/2013/11/12/paternalism/>.

⁵ Следует отметить, что «La Psychologie Économique» переводится как «Психология Экономического», т.е. речь идет о психологической стороне экономического поведения человека. И, видимо, более адекватным является перевод названия книги «Психологическая экономика», а не «Экономическая психология».

расходуется на покупку дорогостоящих предметов, рассчитанных на длительное пользование. Тем самым происходит постепенное формирование материальных накоплений. Однако при переходе определенного порога роста доходов человек отдаляется от положения и психологии наемного работника, основные траты которого направляются на личное потребление, и приближается к положению инвестора, стремящегося вкладывать и приумножать финансовые накопления. Данные наблюдения побудили Кейнса сформулировать основной *психологический закон*, формализованный как *функция потребления* — функция, описывающая взаимосвязь между потреблением и располагаемым доходом:

- с увеличением доходов возрастает и спрос, увеличивается расход на потребление, но не в той же пропорции, что и рост дохода;
- при увеличении уровня доходов замедляется рост личного потребления;
- по мере роста богатства постепенно снижается рост потребления и возрастает часть, откладываемая на сбережения.

Сбережением принято считать разницу между полученным доходом и потреблением. В существовании такого закона «мы можем быть вполне уверены не только из априорных соображений, исходя из нашего знания человеческой природы, но и на основании детального изучения прошлого опыта»¹.

М. Фридмен считал психологической закономерностью стремление индивидов поддерживать постоянной предельную полезность потребления.

На психологические факторы экономисты ссылались и при объяснении отклонения экономического поведения от предсказываемого экономическими моделями: психологические переменные объясняют иррациональные отклонения в поведении индивида в экономической сфере. Но, по убеждению экономистов, в идеале экономическая наука должна быть очищена от психологизма, а понимание следует достигать посредством анализа объективно наблюдаемого поведения экономических агентов, а не их мотиваций².

Индийский ученый Амартия Сен обратил внимание на отсутствие в экономической теории единогласия о роли психологических факторов в поведении экономических агентов, впоследствии названный «парадоксом Сена»³.

Однако рассуждения экономистов о значимости психологических факторов не выдерживали критики с точки зрения профессиональных психологов. Предположения экономистов являлись не столько

¹ Кейнс Дж. М. Общая теория занятости, процента и денег / М. Гелиос АРВ. 1999. С. 96.

² Samuelson P. A Note on the Pure Theory of Consumer's Behaviour // *Economica*. 1938. N.S. № 5 (17). P. 61–71.

³ Lewin S. Economics and Psychology: Lessons For Our Day from the Early Twentieth Century // *J. of Economic Literature*. 1996. № 34. P. 1293–1323.

верифицируемыми результатами психологических исследований, сколько априорными утверждениями, выводимыми из универсальной экономической модели поведения максимизирующего, рационального, информированного отдельного (атомизированного) индивида, не взаимодействующего с другими индивидами.

Психологи также считали:

- неприемлемым исключение психологических переменных, что противоречит интуитивным представлениям о важности и устойчивости влияния психологических факторов на экономическое поведение индивидов и их убежденности в перспективности психологического подхода;

- ошибкой отход неоклассической экономики от исследования многообразия мотивов экономических действий человека и их сосредоточенности исключительно на результатах.

Считается, что американский экономист венгерского происхождения Дж. Катона был, по-видимому, первым, кто ввел в употребление термин "поведенческая экономика"¹. Его книга называется «Психологический анализ экономического поведения»². Позднее им была издана книга «Психологическая экономика»³.

В 1940-е гг. Дж. Катона предложил модель сберегательного поведения, построенную как комбинация психологических переменных и макроэкономических данных. Дж. Катона начал проводить опросы потребителей, которые показали, что реакция покупателей на экономические стимулы может быть объяснена и предсказана. Исследования Дж. Катона стали применяться при решении макроэкономических проблем в области формирования финансовых ожиданий, сбережений, налогообложения, безработицы и инфляции.

Связь между психологией и экономикой проявляется благодаря тому, что в современной экономике воздействия «объективных» экономических условий на поведение людей неизбежно опосредуются их субъективными воззрениями. Люди вынуждены принимать конкретные решения по поводу своего потребления и своих сбережений. Дж. Катона исходил из того, что в условиях неопределенности *экономические ожидания и общественное мнение* оказывают значимое влияние на экономику в целом.

Современная концепция психологической экономики в значительной степени является достижением европейской мысли, тогда как концепция бихевиористского (поведенческой) экономики развивается в основном в США, хотя обе дисциплины появились на североамериканском континенте.

Успешно работающей экономико-психологической моделью макроуровня стал разработанный в США в 1950-е гг. индекс потребительских

¹ Там же.

² Katona G. Psychological Analysis of Economic Behavior / NY. McGraw-Hill. 1951.

³ Katona G. Psychological Economics /. N.Y: Elsevier. 1975.

настроений (Index of Consumer Sentiment, ICS). С минимальными изменениями этот индекс рассчитывается до сих пор. Склонность европейской традиции к психологической экономике побудила аналогичный индекс назвать индексом потребительских ожиданий.

Опросы потребителей показали, что реакция покупателей на экономические стимулы может быть объяснена и предсказана на основе психологических измерений в комбинации с макроэкономическими статистическими данными. Дж. Катона, предложив модель сберегательного поведения, достаточно простую по своим предпосылкам, исходил из того, что сбережения зависят не только от возможности отложить часть дохода на будущее, измеряемой экономическими переменными, но и от желания это сделать.

Дальнейшему развитию бихевиористской (поведенческой) экономики способствовала идея ограниченной рациональности экономических агентов, введенная известным американским ученым в области социальных, политических и экономических наук Гербертом Саймоном.

Введение Г. Саймоном¹ понятия «ограниченная рациональность» не привело к ясности в отграничении от понятия «иррациональность», но усилило скептическое отношение «к постулату рациональности, к обусловленности поведения индивидуумов их стремлением максимизировать свое благосостояние»², хотя и позволило снять «табу» с их иррационального поведения.

В высказывании «ограниченная рациональность» содержится «намек на некую «олимпийскую рациональность», с высот которой можно судить насколько «ограничено», то, что ограничено. Однако в сложной, меняющейся среде в принципе невозможно определить совершенную рациональность. Чтобы обойти данную принципиальную невозможность предлагается представлять совершенную рациональность как «своего рода нормативный стандарт»³, т.е. фактически подменить абстрактный постулат «совершенная рациональность» не менее абстрактным постулатом «нормативный стандарт». Мизес резко и однозначно высказывался по поводу любой такой «упрощающей абстракции».

В экономической теории термину «рациональный» долгое время приписывался особый смысл, не совпадающий с широкой его повседневной трактовкой как «разумный, неабсурдный, неэкстравагантный, неглупый, не противоречащий здравому смыслу и т.д.; умный, здоровый», а рациональный человек рассматривался как «максимизатор, соглашающийся лишь на лучший вариант»⁴.

¹ Саймон Г. Рациональность как процесс и продукт мышления / THESIS. 1993. Вып. 3.

² Рубинштейн А. Я. Теория опекаемых благ и патернализм в экономических теориях: общее и особенное / М. Институт экономики РАН. 2015. С. 9.

³ Дози Дж. Экономическая координация и динамика: некоторые особенности альтернативной эволюционной парадигмы / Вопросы экономики. М. 2012. № 12. С. 40.

⁴ Саймон Г. Рациональность как процесс и продукт мышления / THESIS. 1993. Вып. 3. С. 17.

Г. Саймон, критически переосмысливая экономическое понимание рациональности, обращает внимание на следующее:

— человеческое поведение содержит значительный рациональный компонент, но не следует прибегать к исключительно специфической трактовке рациональности как экономической максимизации, а необходимо ориентироваться на более широкий, обиходный смысл этого понятия;

— экономическая теория не должна ограничиваться узким определением рациональности;

— экономическая теория в основном осуществляла анализ результатов рационального выбора, а не процесса выбора.

Г. Саймон, указывая на ограниченные возможности человеческого интеллекта, отмечает, что многие из «сегодняшних проблем связаны с тем, как мы используем ограниченную информацию и ограниченные вычислительные возможности для решения громадных проблем, масштабы которых едва поддаются осмыслению».

Бесполезно вести речь «о рациональности выбора в общественных делах, не считаясь с тем, какие процедуры имеются в наличии для рационального ранжирования проблем в повестке дня общества, и без учета косвенных последствий действий, предпринятых для достижения конкретных целей или решения конкретных проблем»¹.

В данном контексте речь идет не о непосредственной оценке внешним наблюдателем рациональности или иррациональности экономического поведения человека, принимающего решение о выборе из возможных альтернатив, а о рациональности методов, применяемых при таком выборе, информационных и иных оснований такого выбора.

В повседневном понимании рациональность поведения означает действия, предпринимаемые на основе максимально доступной информации, и средств, адекватных для достижения четко определенных целей. Тогда как в экономической теории рациональность означает выбор, осуществляемый на основании известной, упорядоченной структуры предпочтений и совершенной, бесплатной и доступной информации о вероятностях будущих результатов. *Рациональность означает максимизацию ожидаемой полезности результата.*

Теория экономических механизмов: формализация выбора. В 30-е годы XX века в экономических кругах широко обсуждался практический вопрос: как должна быть организована плановая экономика, чтобы информация, необходимая для ее эффективного функционирования, использовалась наиболее оптимальным образом?

Считалось, что в идеальной рыночной экономике информация, распределенная среди множества независимых субъектов, прежде всего,

¹ Там же. С. 34.

потребителей и производителей, автоматически агрегируется и передается через цены, устанавливаемые «невидимой рукой рынка».

Главными фигурами дискуссии, часто переходящей в острую полемику и споры, были, с одной стороны, Оскар Ланге¹ и Абба Лернер², доказывавшие, что правильно осуществляемое централизованное планирование может имитировать функционирование свободного рынка. Они полагали, что планирование может скорректировать «провалы рынка», особенно проявившиеся в период Великой депрессии, и, тем самым, потенциально превзойти рыночный механизм. Фридрих фон Хайек и Людвиг фон Мизес, с другой стороны, страстно отрицали саму возможность того, что плановая система по успешности когда-то может приблизиться к свободному рынку.

Результаты этой полемики разочаровали отдельных ученых. Так Л. Гурвиц обратил внимание специалистов на недостаток концептуальной точности: ключевые понятия, в частности, «децентрализация» не были определены, а аргументация сторон была неполной. Отчасти это объяснялось тем, что спорщики не опирались на расчеты, им не хватало технического аппарата, в частности, теории игр и математического программирования, чтобы получить убедительные выводы.

Л. Гурвиц предложил недвусмысленное определение центральных понятий, опубликовав две статьи в 1960 и 1972 гг., и введя ключевое понятие согласованности по стимулам (*incentive compatibility*).

Работы, выполненные Гурвицем и другими авторами, убедили экономистов в правоте фон Хайека и фон Мизеса: рынок является «лучшим» механизмом в следующих условиях:

а) имеется так много продавцов и покупателей, что ни один из участников не имеет значительной власти на рынке;

б) нет существенных внешних эффектов (экстерналий), т.е. потребление, производство и информирование одних участников рынка не влияют на потребление и производство других участников.

Вместе с тем, механизмы, совершенствующие рынок, обычно возможны, если даже каждое из допущений нарушается.

Механизм — это институт, процедура выбора для реализации конкретно поставленных целей и задач достижения определенного результата. Важно, кто выбирает тот или иной механизм, т.е. кто конструирует механизм. В случае общественного блага считается, что правительство обеспечивает производство благ, выбирая способ определения уровня обеспечения благом и уровня финансирования.

Если правительству известно, какой выбор общественных благ оптимален, т.е. предполагается, что имеется простой (тривиальный) механизм

¹ *Lange O.* On the Economic Theory of Socialism // *Review of Economic Studies*. 1936. Vol. 4. No 1. P. 53–71.

² *Lerner A.* *The Economics of Control* / N. Y. McMillan. 1944.

достижения оптимума, то нужно лишь издать закон, обеспечивающий этот результат. Также, если заранее известно, какие участники дадут наиболее высокие цены за лоты, аукционист может вручить их непосредственно этим участникам.

Главная трудность в том, что правительство или аукционист обычно не располагают такой информацией. И выбор общественных благ часто просто зависит от предпочтений граждан и отсутствует разумное объяснение того, как правительство заранее узнает о предпочтениях. Также и аукционист обычно не обладает знаниями, как различные покупатели ценят выставленные на продажу предметы.

Заранее, как правило, неизвестно какой результат является оптимальным. Разработчики механизмов стараются избегать прямолинейных действий и принимать авторитарные, волевые решения; а стремятся генерировать и использовать при принятии решений необходимую информацию. Проблема усугубляется тем, что индивиды (граждане в случае общественного блага или покупатели на аукционе) ставят собственные цели, руководствуются личными мотивами и могут не иметь желания и стимула делиться важной информацией, которой обладают. В такой ситуации неполноты знаний и информации неизбежно требование согласования механизмов по стимулам.

При конструировании механизмов осуществляется поиск ответов на следующие важные вопросы:

- а) при каких условиях можно сконструировать согласованные по стимулам механизмы для достижения общественных целей;
- б) какова структура реальных существующих механизмов;
- в) как и в каких случаях теоретически можно доказать отсутствие таких механизмов.

Поэтому конструирование механизмов представляет теоретический интерес, поскольку отсутствуют ясные и очевидные ответы на поставленные вопросы.

В плановой экономике невозможен децентрализованный обмен информацией и становится важным теоретический вопрос: как может быть устроен механизм сбора и использования экономической информации?¹

Возникла необходимость формализации процесса передачи и агрегирования огромного потока и объема экономической информации, представляемой субъектами.

В плановой экономике действуют два основных типа экономических субъектов: центр ответственности, который принимает решения о производстве и потреблении, но не обладает в полном объеме информацией о производственных ресурсах и индивидуальных потребностях,

¹ См.: Hayek F.A. The present state of the debate // *Collectivist Economic Planning* / L.: Routledge, 1935; Hayek F.A. The use of knowledge in society // *American Economic Review*. 1945. Vol. 35, No 4. P. 519–530.

и субъекты на местах, обладающие более полной информацией. Складывается следующий рациональный механизм взаимодействия:

- субъекты (индивиды) сообщают центру о ресурсах, которыми они располагают;

- центр вычисляет оптимальный план производства и отправляет приказы каждому субъекту, что и как производить.

На центр ложится основная вычислительная нагрузка, требующая существенных ресурсов, но отсутствуют как возможности полноценного контроля правильности и обоснованности вычислений, поскольку для проверки необходимы дополнительная информация и вычислительные ресурсы, так и контроля за тем, в какой степени индивиды следуют и исполняют приказы центра.

Субъекты на местах имеют возможность не передавать в центр полную информацию о производственных ресурсах, чтобы получить приказ, соответствующий их собственным предпочтениям, или не выполнять в полном объеме полученные приказы, ссылаясь на сложности и трудности.

Как и в случае плановой экономики, некоторые теоретические вопросы рыночной экономики становятся явными при попытке формализовать механизмы взаимодействия субъектов. Например, как работает «невидимая рука рынка», как совокупный спрос и предложение определяют цену товара? Как и в случае плановой экономики, а priori неясно, будут ли субъекты производить/потреблять в точном соответствии с той информацией, которой они обладают в рыночной ситуации, или будут действовать как-то иначе, руководствуясь интуицией или некоей дополнительной информацией.

В реальности подобные проблемы связаны с асимметричностью информации, с ситуациями, когда участники взаимодействия обладают неполной информацией о предпочтениях и возможностях друг друга, что становится причиной несовершенства рынков.

Л. Гурвиц предложил исследовать децентрализованные рыночные механизмы для того, чтобы понять, как и почему реальные рынки собирают и передают информацию, и можно ли создать специальный экономический механизм для решения конкретных проблем¹.

Идеи Л. Гурвица, У. Викри и Дж. Харшани о важности и необходимости формального анализа взаимоотношений субъектов при наличии асимметричной информации стали применяться во многих областях экономической теории.

В самом общем виде взаимодействие экономических субъектов рассматривается как стратегическая игра — описание того, как могут действовать игроки (экономические субъекты) и к чему приведут различные

¹ Hurwicz L. Optimality and informational efficiency in resource allocation processes // Mathematical Methods in the Social Sciences / K.J. Arrow, S. Karlin, P. Suppes (eds.). Stanford: Stanford University Press, 1960.

наборы действий, т.е. исследуется, как реализуются правила коллективного выбора.

Л. Гурвиц определил механизм как взаимодействие между субъектами и центром ответственности, которое включает три последовательные стадии:

- каждый субъект посылает центру сообщение mi ;
- центр, получив сообщения от всех субъектов, вычисляет ожидаемый результат — $Y = f(m1, \dots, mn)$;
- центр объявляет результат Y и, по необходимости, претворяет его в жизнь.

Многие задачи можно свести к таким простым механизмам, а затем сосредоточиться на свойствах функции f и получить ответы на следующие конкретные вопросы.

Существуют ли механизмы, которые реализуют конкретную функцию при рациональном (равновесном) поведении субъектов, приводящие при обмене к оптимальному распределению ресурсов и/или к равновесию?

Существует ли способ организации аукциона, в результате которого товар продается субъекту, ценящему его выше других участников (эффективные аукционы)?

Как организовать аукцион (механизм продажи), приносящий максимальную выгоду продавцу (оптимальные аукционы)?

Ответы на данные вопросы нетривиальны.

Так, эффективность аукциона зависит от того, что известно о его участниках. Предполагается, что перед началом торгов каждый участник получает информацию о ценности для него товара и обладает, хотя бы расплывчатой, информацией о его ценности для остальных участников. В простейшем случае каждый участник знает точно, какую ценность представляет для него товар и знает вероятностное распределение ценности объекта для каждого из остальных участников. Если информация каждого субъекта не связана с информацией о предпочтениях остальных, аукцион второй цены является эффективным, а равновесие равновесием в доминирующих стратегиях: в интересах каждого игрока делать ставку, равную своей оценке товара вне зависимости от того, что делают другие участники аукциона. Тогда как аукцион первой цены эффективен только при условии, что оценки ценности товара для участников аукциона получены на основании одного и того же вероятностного распределения.

Введенное Л. Гурвицем¹ при анализе механизмов и игр с асимметричной (неполной) информацией ключевое условие совместимости стимулов (incentive compatibility) фактически является положением

¹ Hurwicz L. On informationally decentralized systems // Decision and Organization / R. Radner, C. B. McGuire (eds.). Amsterdam: North-Holland. 1972.

о рациональности поведения экономических субъектов: каждый выбирает то, что считает лучшим для себя.

При доминирующих стратегиях условия совместимости стимулов обеспечиваются лишь в случае, если в процессе взаимодействия каждому выгоднее делиться с другим достоверной и полной информацией, чем скрывать ее.

Р. Майерсоном¹ были сформулированы основные составляющие оптимальных аукционов:

- принцип выявления (Revelation Principle);
- теорема об эквивалентности доходов (Revenue Equivalence Theorem);
- описание общего устройства (конструкции) оптимальных аукционов.

Эти результаты дают фундаментальное обоснование теоретической и практической значимости теории игр. Из них следует, что в доминирующих стратегиях не важны ограничения, накладываемые на механизм при предположении, что субъекты сообщают достоверную информацию о личных выгодах и о типах решения.

Согласно теореме об эквивалентности доходов, при любом применяемом механизме производство общественных благ эффективно только тогда, когда суммарная выгода всех субъектов превосходит издержки.

В формальной постановке задача нахождения оптимального механизма заключается в следующем. Каждый игрок знает свою предельную оценку объекта (тип) — максимальную сумму, которую он готов заплатить. Остальные, включая продавца, знают только статистическое распределение этой оценки. Задача сводится к поиску параметров при определенных ограничениях. Сложность в том, что возможные способы продажи (механизмы) потенциально разнообразны и не ограничены. Для упрощения этой теоретической задачи Майерсоном и был сформулирован, доказан и применен принцип выявления.

При предположении, что задан конкретный механизм или игра с неполной информацией, фиксируется определенное равновесие в игре: набор стратегий игроков, предписывающих каждому участнику играть определенным образом при каждой конкретной предельной оценке товара. При этом неважно, равновесие какого класса зафиксировано — байесовское, в доминирующих стратегиях или апостериорное (*ex post*). У произвольного игрока есть оптимальная стратегия: функция, определяющая его действия в зависимости от предельной оценки. У игрока есть агент, который может вычислить и сыграть за него функцию-стратегию. Что произойдет, если в игре заменить игрока на агента? Предоставит ли игрок агенту полную и достоверную информацию о своем типе? Если игрок не представит такую информацию, то агент будет играть не так, как предписывает оптимальная стратегия игрока при настоящей предельной оценке, а значит, игрок должен представить полную и достоверную информацию.

¹ Myerson R. Optimal auction design // Mathematics of Operations Research. 1981. Vol. 6. No 1. P. 58–73.

Если заменить всех игроков на агентов, то получится новая игра, в которой стратегией каждого игрока будет сообщение о своем возможном типе, а механизмом — простая функция, отображающая набор сообщений от всех игроков в конечный результат. Такой механизм получается в результате игры агентов игроков в согласии с равновесными оптимальными стратегиями в первоначальной игре. Игра называется прямой, если множество стратегий каждого игрока совпадает с множеством его типов. В такой прямой игре представлять полную и достоверную информацию («говорить правду») оптимально для каждого игрока. Причем если изначальное равновесие было достигнуто в доминирующих стратегиях, то и «говорить правду» является доминирующей стратегией.

Таким образом, для любой игры с неполной информацией и любого равновесия этой игры существует прямая игра (зависящая и от первоначальной игры, и от равновесия) с равновесием, обладающим следующими свойствами:

- все игроки «выявляют» свои типы, сообщая их правдиво;
- результат игры такой же, как и в первоначальной игре (*принцип выявления*), для выполнения которого как математического результата необходимо зафиксировать концепцию равновесия.

Как бы ни был сложен оптимальный механизм, существует прямой механизм, в котором есть правдивое равновесие, приводящее к тому же самому результату, в частности к такой же ожидаемой выручке продавца. Поэтому, для ответа на вопрос, какой доход может получить продавец, достаточно рассмотреть прямые механизмы, в которых все игроки в равновесии говорят правду.

Прямой механизм, в свою очередь, задается двумя функциями, зависящими от полученного набора сообщений:

- распределения (allocation function), определяющего, кто получает товар;
- платы (payment function), определяющей, кто и сколько платит.

Условие, что все игроки говорят правду, превращается в два условия: совместимости стимулов (incentive compatibility), требующее, чтобы ожидаемая полезность от сообщения правды превышала ожидаемую полезность от любого другого сообщения, и условие рационального участия (individual rationality) — ожидаемая полезность не меньше той, которую игрок получил бы, не участвуя в игре.

В итоге задача поиска оптимального механизма сводится к задаче выбора функций распределения и платы при ограничениях участия и совместимости стимулов. Майерсон разрешил эту задачу в общем виде, предполагая, что каждый игрок имеет квазилинейную функцию полезности и нейтрален к риску, а предельные оценки игроков должны быть статистически независимы, ограничены сверху, но не обязательно одинаково распределены.

Майерсон проанализировал условия совместимости стимулов и вывел более простые и интуитивно ясные ограничения на функцию распределения товара: для любого субъекта вероятность получения товара должна возрастать по его предельной оценке. Ожидаемая полезность для любого субъекта не зависит от функции платы и равна константе плюс интеграл от вероятности получения товара. Интегрирование плат, ожидаемых от всех игроков, ведет к фундаментально важной *теореме об эквивалентности доходности*: любые два механизма (не обязательно прямые) с равновесиями и одинаковыми функциями распределения, в которых игроки одного конкретного типа (например, игроки с нулевой оценкой) получают одинаковую полезность, дают продавцу одинаковый ожидаемый доход. Агрегируя ожидаемые доходы от всех типов игроков, Майерсон показал, что учитывая условия совместимости стимулов максимальная плата, которую можно потребовать от конкретного игрока конкретного типа, легко вычислима и является *виртуальной предельной ценностью* игрока, которая всегда ниже реальной ценности и отражает издержки на предоставление стимулов. Из данного ключевого соображения «выросла вся информационная экономика»¹.

Полученные результаты показали, что асимметричная (неполная, несовершенная) информация играет в экономике очень важную роль. При полной информации эффективное распределение ресурсов возможно, а при неполной — проблематично или вообще невозможно.

Что определяет возможность решения определенной экономической задачи? Какова функция, которая задает «разрешимую задачу»? Можно ли выделить универсальные простые свойства функции, определяющие разрешимость задачи? Можно получить ответ, анализируя конкретные условия совместимости стимулов, но можно ли узнать и без утомительного анализа? Даже если условия совместимости стимулов выполнены, то прямой механизм может быть «забракован», если допускает другие равновесия, которые не достигают желаемого результата. Нет гарантии, что взаимодействующие субъекты, играя, попадут именно в «нужное» равновесие.

В терминах теории реализации (implementation theory), данные вопросы могут быть сформулированы следующим образом:

а) при каких условиях можно реализовать правило коллективного выбора?

б) какой вид имеет механизм реализации?

в) какие правила коллективного выбора нельзя реализовать?

Поиск ответов позволил Э. Маскину обнаружить, что свойство, называемое монотонностью (монотонность по Маскину), является ключевым для реализуемости в равновесиях Нэша.

¹ Измаков С., Сонин К., Юдкевич М. Теория экономических механизмов (Нобелевская премия по экономике 2007 г.). // Вопросы экономики. М. 2008. № 1. С. 15.

Выдающийся вклад в теорию экономических механизмов Э. Маскина¹ заключается в следующем:

- сформулирована задача имплементации² (implementation problem), предписывающая приведение равновесий конструируемых механизмов к желаемой экономической функции;

- определены условия, необходимые для имплементации, в частности, условия монотонности (по Маскину) для имплементации по Нэшу;

- предложены конкретные механизмы, в частности, универсальный механизм имплементации.

Теорию конструирования экономических механизмов можно рассматривать как «инженерную» сторону экономической теории.

Изначальная задача обманчиво проста. Есть несколько экономических субъектов (игроков) и несколько возможных альтернатив. Предпочтения игроков могут быть совершенно произвольными и различными.

Есть также некий, возможно гипотетический, центр (правительство, конструктор, дизайнер механизмов), который намерен выбрать определенную альтернативу (одну из нескольких) в зависимости от предпочтений индивидуальных игроков и согласно некоторому правилу общественного выбора (social choice rule).

Задача заключается в том, чтобы найти механизм, следуя которому рациональные игроки смогут достичь альтернативы, предписываемой общественными правилами для данных предпочтений, для любых других возможных предпочтений, во всех возможных равновесиях. Такой механизм, если существует, тавтологичен, поскольку фактически выявляет информацию уже известную игрокам. Несложно найти механизм, в котором «говорить правду о предпочтениях» является оптимальной стратегией для каждого игрока. Имеется множество равновесий, где игроки сообщают произвольный фиксированный набор предпочтений — правдивых или нет. Но если все говорят одно и то же, то рационально подтвердить их слова. Тогда вопрос о нежелательных равновесиях остается открытым.

До результатов Маскина было известно, что если концепция равновесия основана на доминирующих стратегиях, то никакие правила выбора практически не реализуемы. Более точно, если правило выбора таково, что каждая альтернатива выбирается для какого-то набора предпочтений, то такое правило достижимо в доминирующих стратегиях только если есть диктатор, то есть если в любом случае выбирается альтернатива, предпочтенная конкретным игроком. Маскин показал, что если концепцией равновесия является равновесие по Нэшу, то множество достижимых общественных правил намного больше, и, что, возможно, более важно, такое множество достаточно просто описывается.

¹ Maskin E. Nash equilibrium and welfare optimality // Review of Economic Studies. 1999. Vol. 66, No 1. P. 23–38.

² Конструирования, реализации, внедрения.

Фундаментальное наблюдение состоит в том, что необходимым условием реализуемости социального правила является условие монотонности. *Теорема 1 гласит: если правило коллективного выбора реализуемо, то оно должно быть монотонно.*

С точки зрения применимости и соблюдения условия монотонности была рассмотрена знаменитая история царя Соломона¹.

К царю пришли две женщины и принесли ребенка. Каждая женщина утверждает, что ребенок ее и просит отдать младенца ей, но доказать материнство не может. Царь угрожает убить ребенка, рассчитывая на благоразумие обеих женщин — на то, что настоящая мать предпочтет отдать ребенка в чужие руки, а не убить его. По легенде так и происходит: мудрый Соломон возвращает ребенка той женщине, которая предпочла отдать его другой. Действительно ли Соломон поступил мудро или как диктатор, авторитарно приняв волевое решение отдать ребенка женщине, ответ которой был признан как более благоразумный?

Таким образом, с точки зрения условия монотонности задача оказывается неразрешимой, а правило коллективного выбора нереализуемо, поскольку отсутствует механизм реализации — «благоразумные (рациональные) женщины не смогли бы добиться результата, которого желает Соломон. Быть может, реальная история (если она действительно произошла) передана неточно или женщины не рассматривали ситуацию стратегически»².

Если налагается дополнительное ограничение, то монотонность гарантирует реализуемость, при условии, что в рассматриваемом случае есть хотя бы три индивида. Это ограничение — отсутствие права вето. Если все индивиды, за исключением одного, согласились, что определенный вариант выбора является лучшим для них, то они помещают этот вариант в начало списка предпочтений. Тогда, если правило коллективного выбора удовлетворяет условию отсутствия права вето, то данный выбор является оптимальным. Иначе говоря, оставшийся индивид не может наложить вето на коллективное решение. Отсутствие права вето безобидно, поскольку вообще не налагает никаких ограничений, когда исходы определяют распределение экономических благ между несколькими индивидами.

Общий результат о возможности реализации правила коллективного выбора сформулирован в следующей *теореме 2: при допущениях, что действует не менее трех индивидов, правило коллективного выбора удовлетворяет условиям монотонности и отсутствует право вето, то такое правило реализуемо.*

Для теории реализации три участника облегчают положение, поскольку идея механизма реализации состоит в предоставлении

¹ Пример приведен в: *Moore J. Implementation, Contracts, and Renegotiation in Environments with Complete Information* / Доклад на Конгрессе Эконометрического общества в Лондоне. 1992.

² Измалков С., Сонин К., Юдкевич М. Теория экономических механизмов. (Нобелевская премия по экономике 2007 г.) // Вопросы экономики. М. 2008. № 1. С. 20.

индивидам стимулов вести себя так, чтобы обеспечить оптимальный результат, что влечет за собой «наказание» индивида за отклонение от его предписанной (равновесной) стратегии. Но если индивидов два, и один из них отклонился, то без дополнительных предположений и ограничений трудно определить, отклонился ли другой индивид при исполнении стратегии одним из них. Проблема идентификации разрешается при наличии трех или более участников: отклонившийся участник выделяется явно, когда двое и более других участников действуют в согласии с равновесием.

Таким образом, согласно теореме Маскина *при наличии не менее трех индивидов* любое монотонное социальное правило, которое к тому же не подвержено действию вето (no veto power), достижимо. Социальное правило не подвержено вето, если любая альтернатива, которую все, возможно, кроме одного индивида, считают для себя наилучшей, принадлежит множеству выбора. Маскин конструктивно доказывает эту теорему, предлагая конкретный механизм для достижения желаемого социального правила, при котором каждому индивиду сообщается набор предпочтений (всех игроков), альтернатива и натуральное число.

Если все игроки правдиво называют предпочтения и желаемую альтернативу, то ни один игрок не захочет отклоняться от равновесия. Ведь если он отклонится так, что будет выбрана другая альтернатива, которая окажется для него худшей. Так достигаются все желаемые альтернативы, а нежелательные не достигаются, поскольку использование монотонности позволяет их отсеять.

Единственный недостаток предложенного механизма заключается в том, что для того чтобы отсеять некоторые из возможных нежелательных равновесий, игрокам предлагается сыграть в игру «кто назовет большее число». Сложно представить, что такой компонент будет использоваться в реальных практических механизмах. Если конкретное правило достижимо, то, возможно, для него существует более простой и практичный механизм. Замечательность предложенного механизма заключается в том, что он прямо (просто и естественно) связывает монотонность с условиями совместимости стимулов и в его универсальности. Описанный механизм можно применять для любой задачи. Конкретный механизм зависит только от возможного набора альтернатив и желаемой социальной функции.

Для формализации процессов индивидуального и коллективного выбора, построения социально-экономических механизмов широко применяются вероятностные математические модели. И после каждого существенного прорыва в моделировании возникают проблемы рациональной интерпретации полученных результатов.

По Мизесу «самое большое, чего можно добиться относительно реальной действительности, — это вероятность»¹.

¹ Там же. С. 84.

Проблема вероятного вывода «значительно шире, чем проблемы, составляющие область вычисления вероятности. Только историческое первенство математической трактовки могло привести к предубеждению, что вероятность всегда означает частоту.

Другая ошибка состоит в смешении вероятности с проблемой индуктивного рассуждения, применяемого в естественных науках»¹.

Утверждение вероятно, если недостаточно знания относительно его содержания и осуществления выбора.

Мизес выделяет два различных случая вероятности: *вероятность класса и вероятность события*.

Вероятность класса означает наличие знания или предположение о знании «относительно рассматриваемой проблемы о поведении целого класса событий или явлений, но о реальных единичных событиях и явлениях неизвестно ничего, кроме того, что они являются элементами этого класса»².

Тогда как «вероятность события означает: относительно конкретного события мы знаем ряд факторов, которые определяют его исход, но существуют и другие определяющие факторы, о которых мы не знаем ничего.

Вероятность события не имеет ничего общего с вероятностью класса, кроме неполноты нашего знания. Во всех остальных отношениях они абсолютно различны.

Конечно, во многих случаях люди пытаются предсказать конкретное будущее событие на основе своего знания о поведении класса»³.

Поскольку средства в одинаковом количестве и одного качества всегда производят одинаковое количество действия одного качества, «деятельность не делает различий между конкретными определенными количествами однородных средств. Однако это не означает, что она приписывает одинаковую ценность разным частям запаса однородных средств».

Деятельность «всегда сталкивается с альтернативными вариантами, между которыми делает выбор. Выбор всегда делается между определенными количествами средств»⁴.

Предпочтение и отклонение, а также акты выбора и принимаемые решения, в которых они реализуются, не являются актами измерения. Деятельность не измеряет полезность или ценность; она выбирает между альтернативными вариантами.

Понятия совокупной полезности и совокупной ценности бессмысленны, если не применяются в ситуации, где люди должны делать выбор между совокупными запасами.

Субъективная оценка относится только «к запасу, с которым связан конкретный акт выбора. Запас ex definitione [по определению (лат).]

¹ Там же.

² Там же.

³ Там же. С. 86.

⁴ Там же. С. 92.

всегда состоит из однородных частей»¹, каждая из которых может быть заменена любой другой частью.

Интуитивные догадки Мизеса о двух типах вероятности были конкретизированы и формализованы основоположником латентно-структурного анализа² (ЛСА), американским социологом П. Лазарсфельдом (1901–1976), который начинал научную деятельность в Венском кружке, а после эмиграции активно занимался в США проблемами эмпирической и прикладной социологии.

П. Лазарсфельд отмечал, что на формирование основных идей ЛСА существенное влияние оказали логический эмпиризм (Р. Карнап, К. Гемпель и др.) и практика социологических исследований.

Для решения проблемы соотношения теоретического и эмпирического П. Лазарсфельд предложил:

- использовать идею диспозиции, логическую операцию частичного определения или редукции;
- признать, что отношения между эмпирическими индикаторами (признаками) и диспозиционными предикатами (классификационными понятиями), являющимися теоретическими терминами, наиболее близкими к эмпирическим, носят вероятностный характер.

Согласно П. Лазарсфельду параметры исследуемых объектов, которые характеризуются разнообразными индикаторами, являются латентными и должны быть выведены из наблюдений. Проблема измерения заключается в том, чтобы вывести латентные параметры из явных данных. Отбор признаков — сложный процесс, т.к. каждому классификационному понятию соответствует «универсум признаков», из которого при применении конкретного инструмента измерения могут быть выбраны различные определенные наборы, объединяемые в индексы и приводящие к различающимся результатам классификации.

П. Лазарсфельд ввел *правило взаимозаменяемости индексов*, неизбежной платой за практические достоинства которого является невозможность достижения «чистой» классификации. Но прогресс в рациональном теоретическом осмыслении реальности и в эмпирической работе позволяет надеяться на разработку со временем более тонких и точных инструментов классификации.

Данные теоретические и практические предпосылки предопределили концептуально непреходящее значение ЛСА. Для определения соотношения между классификационным понятием и индикаторами, объединенными в индекс, П. Лазарсфельдом была введена аксиома локальной независимости, которая постулирует, что при фиксированном значении

¹ Там же. С. 94.

² Дегтярев Г. П. Анализ латентно-структурный // Российская социологическая энциклопедия. М., 2009; Дегтярев Г. П. Построение типологии с помощью модели латентных классов // Математические методы в социологическом исследовании. М., 1983.

латентной переменной индикаторы должны быть независимыми. Первоначально в ЛСА рассматривались лишь дихотомические признаки. Если задано n дихотомических признаков, определяющих явное пространство, и предполагается существование m латентных классов, то имеются следующие латентные параметры:

а) латентные вероятности принадлежности каждого из признаков i, j, k и т.д. к латентному классу α :

$$p_i^\alpha \quad (i = 1, 2, \dots, n \quad \alpha = 1, 2, \dots, m);$$

б) относительные частоты латентных классов:

$$v_i^\alpha \quad (\alpha = 1, 2, \dots, m)$$

Система расчетных уравнений для модели m латентных классов определяется следующим образом:

$$\sum_{\alpha=1}^m v_i^\alpha = 1$$

$$p_i = \sum_{\alpha=1}^m v_i^\alpha p_i^\alpha$$

$$p_{ij} = \sum_{\alpha=1}^m v_i^\alpha p_i^\alpha p_j^\alpha$$

$$p_{ijk} = \sum_{\alpha=1}^m v_i^\alpha p_i^\alpha p_j^\alpha p_k^\alpha \quad i, j, k = 1, 2, \dots, n,$$

где p_i, p_{ij}, p_{ijk} и т.д. — явные вероятности, определяемые на полной совокупности объектов. p_i — вероятность принадлежности признака i всей совокупности исследуемых объектов, p_{ij} — вероятность принадлежности признака i и признака j всей совокупности объектов и т.д.

Детерминантный метод, используемый для доказательства существования решения данной системы расчетных уравнений, установил следующее соотношение между пространством эмпирических признаков и латентным пространством: $n \geq 2m - 1$. В данном случае можно говорить о достаточном для целей классификации количестве признаков. В частности, в случае модели двух латентных классов необходимо использование *не менее трех признаков для задания латентной структуры и получения единственного решения*. Это — результат фундаментальной важности, устанавливающий существенное отличие ЛСА от факторного анализа и других методов многомерной классификации, использующих информацию лишь о парной корреляции признаков. Данный результат удивительно схож и с выводами Э. Маскина о наличии *не менее трех индивидов при применении правила коллективного выбора*.

Концептуально изящный латентно-структурный анализ на практике столкнулся со значительными вычислительными и статистическими трудностями и сначала оказался неприемлемым для большинства социальных исследователей.

В 1960–1970-е годы об этом свидетельствовало отсутствие убедительных результатов анализа социальных данных, несмотря на признание исследователями громадных потенциальных возможностей латентно-структурной техники как языка для описания, выражения, объяснения и интерпретации в социально-экономических исследованиях.

Достижения 1980–2000 гг. в разработке численных алгоритмов (Е. В. Andersen, Т. W. Anderson, С. С. Clogg, L. A. Goodman, S. J. Haberman etc.) и вычислительной техники сделали ЛСА более доступным. В 2010-е годы ЛСА стал все более широко применяться в социально-экономических исследованиях.

Стандартная «аксиома однородности экономических агентов и их предпочтений»¹ может быть интерпретирована и формализована как аксиома локальной независимости, что позволяет изящно решить проблему соотношения однородности и неоднородности (гетерогенности).

Локальная независимость определяет латентные классы, внутри каждого из которых поведение индивидов (экономических агентов) является однородным, но вся совокупность классов, а, следовательно, и совокупность экономических агентов и их предпочтений неоднородна (гетерогенна). И, соответственно, более адекватно и рационально можно интерпретировать возможность построения политики государства, что «оно действует в обществе с гетерогенными агентами и социальными группами с противоположными интересами»². В таком случае предпосылка неоднородности рассматривается как более адекватный методологический принцип.

Возможные интерпретации условия (принципа) гетерогенности как наличия различных экономически агентов фактически означают введение следующих скрытых (латентных) классов:

- «эксперт по этике» П. Самуэльсона, как внешний наблюдатель, находящийся вне экономики;

- «подталкивание индивидов, причем со стороны внешнего субъекта, к принятию «правильных решений»³;

- «другие люди» — «политики», предпочтения которых отличаются от предпочтений индивидов при принципиально «другом поведении» этой группы экономических агентов в отношении совершенно «других событий».

¹ Рубинштейн Л. Я. Методологический анализ теории опекаемых благ / М. Институт экономики РАН. 2014. С. 36.

² Там же.

³ Там же. С. 38.

Видимо, следует ожидать конвергенцию и сближение подходов, применяемых при моделировании экономических и социальных процессов, в ситуациях использования ассиметричной (неполной, несовершенной) информации и выявления скрытых (латентных) факторов и переменных, расширение интерпретации.

Процессы рационализации: некоторые выводы и предложения. Механизмы экономического взаимодействия значимы не только для микроэкономики. Работы, заложившие технические основы теории механизмов, сначала были далеки от институциональной тематики. Но в более поздних работах делается попытка связать теорию конструирования механизмов с проблемами институциональной теории.

Л. Гурвиц указывает, что задача состоит в том, чтобы «облегчить коммуникацию, интегрировав институциональные феномены в модели, которые были построены для изучения экономик, систем голосования и организаций». И «неэкономические аспекты не могут быть оставлены без внимания»¹.

Возможна интеграция двух направлений: экономической теории с ее мощным формальным математическим аппаратом и институционализма.

Подходы к определению понятия института можно условно разделить на две группы. К одной группе относятся работы исследователей, которые определяют институты как правила игры в обществе, снабженные механизмами принуждения к исполнению этих правил. Основателем этого подхода считается нобелевский лауреат Д. Норт². Рассмотрение существующих экономических институтов было ориентировано на объяснение и предсказание экономических и социальных последствий, порождаемых этими институтами.

Другую группу представляют работы, в которых институты рассматриваются как равновесия совокупности стратегий участников взаимодействия³ и проводится анализ институтов, формирующихся в процессе взаимодействия экономических субъектов.

Л. Гурвиц был близок к Норту: «термином “институт” могут обозначаться как правила, так и результирующие форматы (patterns) поведения. Рынок является таким примером. Но с точки зрения выбора политики представляется логичным, что именно правила могут быть подвержены намеренным изменениям, в то время как изменение поведения в рамках этих правил является следствием. В силу этого мы склоняемся

¹ Hurwicz L. Toward a Framework for Analyzing Institutions and Institutional Change / Markets and Democracy / S. Bowles, H. Gintis, B. Gustafsson (eds.) // Cambridge: Cambridge University Press. 1993. P. 51.

² Норт Д. Институты, институциональные изменения и функционирование экономики / М.: Начала. 1997; Ostrom E. An agenda for the study of institutions // Public Choice. 1986. Vol. 48. No. 1. P. 3–26.

³ Schotter A. The economic theory of social institutions / Cambridge: Cambridge University Press, 1981.

к рассмотрению институтов как правил, нежели институтов как форматов поведения»¹.

По мере развития теории конструирования экономических механизмов в исследованиях стали определять *социальную цель или желаемый результат* и конструировать соответствующий институт (механизм), ориентированный на достижение поставленной цели.

Людвигом фон Мизесом были заложены основы исследования человеческой деятельности в категориях «цель», «средство», «результат», многократно обсуждены взаимосвязи этих категорий в различных контекстах, в том числе в терминах рациональности и иррациональности.

Действующий человек выбирает, определяет и пытается достичь поставленных целей. Действие реально и является проявлением человеческой воли, которая означает способность человека выбирать между различными состояниями, предпочитать одно, отвергать другое и вести себя в соответствии с решениями, принятыми для реализации избранных состояний и отказа от остальных при стремлении достичь поставленных конечных целей. Применительно к средствам, избираемым для достижения цели, «*понятия рациональное и иррациональное* подразумевают оценку целесообразности и адекватности применяемых процедур»².

Рациональна наука, стремящаяся достичь мысленного понимания социально-экономических процессов посредством систематического упорядочивания имеющихся знаний. Экономическая теория может развиваться только до пределов возможностей применяемых рациональных методов.

Важно понимание смысла и значимости человеческой деятельности, при исследовании которой применяются две основные рациональные познавательные процедуры: концептуализация (*conception*) и понимание-интерпретация (*understanding*).

То, что доступно познанию «необходимо рационально. Не существует ни иррационального способа познания, ни науки об иррациональности»³.

Макс Вебер «сделал процессы рационализации доступными для обширного эмпирического изучения»⁴, развивая тематику рациональности в научном и других контекстах.

Вебер постоянно напоминает, что «рационализм» может иметь различные значения. Все зависит от того, подразумевают ли «тот тип рационализации, который производится, например, размышляющим систематиком вместе с определенной картиной мира: возрастающее теоретическое овладение реальностью посредством все более точных абстрактных понятий; или скорее

¹ Hurwicz L. Implementation and enforcement / Political Economy, Institutions, Competition, and Representation. W.A. Barnett, M.J. Hinrich, N.J. Schofield (eds.) // Cambridge: Cambridge University Press, 1993. Ch. 2. P. 51–59.

² Там же. С. 23.

³ Там же. С. 70.

⁴ Хабермас Ю. Теория рационализации Макса Вебера / Социологическое обозрение. М. Т. 8. № 3. 2009. С. 37.

рационализацию в смысле методического достижения определенной практической цели через все более точный расчет адекватных средств. Это различные вещи, несмотря на их, в конечном счете, неразрывное единство»¹.

Практическая рациональность означает, что «целерационально действует тот, кто ориентирует свои действия в соответствии с целями, средствами и побочными следствиями и при этом рационально взвешивает как средства в отношении целей, так и цели в отношении побочных следствий, и, наконец, различные возможные цели в отношении друг друга, то есть, во всяком случае, не действует ни аффективно... ни традиционно»².

Вебер исходит из широкого понятия техники, чтобы показать, что аспект управляемого применения средств в абстрактном смысле соответствует рациональности поведения. «Рациональной техникой» он называет применение средств, «которое сознательно и планомерно ориентировано на опыт и размышление...»³.

Наличие «технического» вопроса всегда означает, что существуют сомнения относительно наиболее рациональных средств⁴.

Единственным критерием, по которому измеряется в самом широком смысле слова «техническая» рационализация, является регулярность воспроизводимого поведения, на которое другие могут сознательно ориентироваться⁵.

Значение «техники» и «рационализации средств» Вебер ограничивает, специфицируя средства. Если во внимание принимаются средства, с помощью которых способный действовать субъект может реализовать поставленные цели через вмешательство в объективный мир, то становится значимым оценочный критерий эффективности. Рациональность применения средств измеряется по поддающейся объективной проверке эффективности вмешательства (или целенаправленного бездействия). Это позволяет провести различие между «субъективно целерациональными» и «объективно правильными» действиями. Можно также говорить о «прогрессирующей рациональности средств» в объективном смысле: «Если человеческое поведение (любого рода) ... технически «более правильно» ориентировано, чем раньше, то можно говорить о «техническом прогрессе»⁶.

Подлежат рационализации и целеориентированные действия. К условиям целерационального действия относится не только субъективно предполагаемая или эмпирически определяемая инструментальная рациональность средств, но и рациональность выбора в процессе целеполагания,

¹ Weber M. *Gesammelte Aufsätze zur Religionssoziologie* / Bd. 1. 196. P.265.

² Weber M. *Wirtschaft und Gesellschaft* / Köln. 1964. P.18.

³ Там же. С. 14.

⁴ Там же. С. 44.

⁵ Вебер М. Смысл «свободы от оценки» в социологической и экономической науке / Вебер М. Избранные произведения // М.: Прогресс. 1990. С. 585.

⁶ Там же.

произведенного в соответствии с ценностями. С этой точки зрения действие может быть рациональным лишь в той мере, в какой оно не управляется аффектами и не руководствуется традициями. Существенным компонентом «рационализации» действия «является замена внутреннего следования привычным обычаям на планомерное приспособление к диспозициям интересов»¹.

В этой связи важно различие формальной и материальной рациональности. По мере освобождения от связей с традициями и влияния аффектов действующий субъект, рефлексируя, начинает осознавать и прояснять свои предпочтения и на их основе выбирать цели. Такое действие может оцениваться как в инструментальном аспекте эффективности применения средств, так и в аспекте правильности и обоснованности формулирования целей при имеющихся предпочтениях, средствах и предельных условиях. Оба эти аспекта «инструментальной рациональности и рациональности выбора вместе взятые, Вебер называет формальной рациональностью, в отличие от материальной оценки системы ценностей как таковой, лежащей в основе предпочтений»².

С точки зрения формальной рациональности может быть выдвинуто лишь требование, чтобы действующий субъект осознавал свои предпочтения, в процессе рационализации уточнял лежащие в основании ценности, проверял их на непротиворечивость, приводил их, по возможности, в транзитивный порядок и т.д.

В отношении нормативных вопросов Вебер — скептик, будучи убежденным в том, что решение в пользу той или иной (аналитически проясненной) ценностной системы не может быть обосновано и рационально мотивировано. Строго говоря, *нет рациональности ценностных постулатов или рациональности верований с точки зрения их содержания*. Тем не менее, способ, каким действующий субъект обосновывает свои предпочтения, то, как он ориентируется на ценности, по мнению Макса Вебера, допускает рассмотрение действия как поддающегося рационализации.

Таким образом, согласно М. Веберу, процессы рационализации понижают или, во всяком случае, должны пронизывать все аспекты человеческой деятельности, являются основой прогресса и цивилизационного развития.

¹ Weber M. Wirtschaft und Gesellschaft / Köln. 1964. P.18.

² Хабермас Ю. Теория рационализации Макса Вебера/ Социологическое обозрение. М. Т. 8. № 3. 2009. С. 52.