

Р.И. Капелюшников  
ИМЭМО РАН; НИУ ВШЭ, Москва

## Статус принципа рациональности в экономической теории: прошлое и настоящее

**Аннотация.** Рассматриваются различные трактовки идеи рационального поведения в экономической теории. Автор приходит к выводу, что хотя за последние десятилетия позиции принципа рациональности как в эмпирических, так и в теоретических исследованиях оказались существенно подорванными, это скорее всего не приведет к утрате им своего традиционного статуса в качестве базового методологического ориентира для экономического анализа.

**Ключевые слова:** поведенческая экономика, методология, рациональный выбор, принцип рациональности.

Классификация JEL: A12, B41, D01, D03.

Я воспринял вопрос, давший название нашему круглому столу, совершенно буквально и поэтому попытаюсь дать на него буквальный ответ.

Как хорошо известно, понятие рациональности в том виде, в каком оно закрепилось в экономической теории, является не содержательным, а формальным. Оно характеризует не содержание целей, которые преследует экономический агент (они, строго говоря, могут быть любыми), а всего лишь их отношения друг с другом, а также отношения между ними и используемыми для их достижения средствами.

Если попытаться дать минималистское нетехническое определение рационального поведения, то оно, как мне кажется, может быть сведено к двум пунктам:

1) предполагается, что экономические агенты обладают согласованной, внутренне непротиворечивой шкалой предпочтений;

2) предполагается, что при принятии решения экономические агенты используют всю доступную релевантную информацию (релевантную именно для данного конкретного решения).

Исходно в экономической теории основной акцент делался на первом пункте, второй начал активно разрабатываться относительно недавно. Однако это не значит, что «старые» экономисты не осознавали его важности: например, когда Л. фон Мизес пишет, что рациональное поведение предполагает, что экономический агент быстро, насколько это возможно, адаптируется к изменившимся условиям (Мизес, 2000), то это по существу — та же самая идея, только выраженная иначе.

Если принять такое минималистское определение рациональности, то естественно спросить, что с этим определением можно делать и что с ним реально делают экономисты. А делать с ним можно очень разные вещи.

1. Прежде всего можно задаться вопросом, рационально ли поведение «эмпирических» индивидов. Вопреки традиционным обвинениям со стороны философов, социологов, психологов «старые» экономисты никогда не настаивали на том, что люди всегда и во всех случаях ведут себя рационально. Они открыто утверждали обратное, описывая человека как невежественное, недалекое существо, не любящее прислушиваться к голосу разума. Исходя из соображений здравого смысла и элементарного житейского опыта, они полагали иррациональность индивидуального поведения самоочевидным фактом, но не считали, что сама эта проблема относится к предмету их науки.

Ситуация изменилась с появлением теории игр, когда в экономическую науку хлынула волна математиков. Идея рациональности (в форме предположения о максимизации ожидаемой полезности) была воспринята ими буквально — как утверждение о рациональности любого индивидуального акта выбора. Отсюда был всего лишь один шаг до попыток проверить его эмпирически: соответствует оно реальности или нет. Достаточно быстро такие попытки последовали, и из них выяснилось, что эмпирически оно не подтверждается. Кульминацией этого тренда можно считать *поведенческую экономику*, показавшую, что во множестве самых различных ситуаций, по крайней мере у значительной части людей, поведение оказывается весьма далеким от канонов рациональности (Капелюшников, 2016).

Итак, можно, по-видимому, считать твердо установленным, что в общем случае индивидуальное поведение не является рациональным в том смысле, в каком это подразумевает предложенное минималистское определение. Однако здесь будет уместно напомнить одно высказывание В. Смита (Smith, 2003). По поводу поведенческой экономики он выразился так: поведенческая экономика — это уже

не экономика, а психология. Думаю, «старые» экономисты с готовностью подписались бы под такой оценкой, поскольку они не считали, что объяснение индивидуального поведения входит в задачи их науки, и никоим образом не претендовали на подобного рода объяснение<sup>1</sup>.

2. Экономисты прошлого считали своей задачей объяснение не индивидуального, а группового, массового поведения, которое является результирующей большого числа актов выбора, совершаемых множеством экономических агентов. Такие авторы, как А. Алчиан и Дж. Беккер (Alchian, 1950; Becker, 1962), прямо указывали: в экономической науке рациональным предполагается не индивидуальное, а рыночное поведение. В пользу этой идеи могли выдвигаться самые разные аргументы. Например, в ход могли идти ссылки на существование особой сферы — назовем ее «экономика», которая активизирует рациональную сторону человеческой природы. Могло также утверждаться, что рынок действует как эффективный фильтр, отсекающий наиболее явные случаи отклонения от результатов, к которым привело бы рациональное поведение, так что формирование рыночных феноменов (например, цен) оказывается свободным от влияния подобных отклоняющихся решений. В этом смысле то, как субъективно строится поведение тех или иных участников, не имеет значения (так, например, они могут делать выбор случайным образом); главное, что общий результат их действий оказывается таким, как если бы они вели себя рационально. И т.д.

Идея рациональности рыночного поведения получила эмпирическую разработку в экспериментальной экономике, где, в частности, было показано, что, погруженные в реальную рыночную среду, даже мало информированные, не имеющие обменного опыта, нерациональные индивиды (например, подростки 10–12 лет) после двух–трех раундов эксперимента научаются вести себя как абсолютно рациональные агенты и достигают результатов, которые предполагаются моделями совершенной конкуренции. Если это так, то тогда рациональность следует рассматривать не столько как индивидуальный, сколько как социальный феномен. Мы видим, что, попадая в определенную институциональную среду, индивиды начинают действовать более рационально, чем они были бы способны действовать вне ее.

В методологическом плане это предполагает, что при построении экономических

моделей между их институциональной плотностью и уровнем индивидуальной рациональности существует trade-off, причем чем институционально стерильнее модель, тем выше требования, предъявляемые к рациональности и всеведению экономических агентов; чем она институционально насыщенная, тем эти требования ниже. В этом смысле институты (правила игры) представляют собой своего рода субституты индивидуальной рациональности. Однако из-за большей простоты выбор экономистов практически всегда склоняется в пользу моделей, сочетающих максимум индивидуальной рациональности с минимумом институциональной специфичности.

3. Вопросы, которые обсуждались в двух предыдущих пунктах, имели эмпирический характер и были связаны с тестированием предположения о рациональности человеческого поведения — либо на индивидуальном, либо на рыночном уровне. Однако в подавляющем большинстве случаев идея рациональности используется экономистами в ином качестве — не в качестве гипотезы, подлежащей проверке, а в качестве одной из базовых предпосылок, которые они принимают по умолчанию при объяснении множества самых различных экономических явлений.

Возникает вопрос, на каком основании они используют в качестве исходной предпосылки положение, про которое заведомо известно, что оно не соответствует действительности (опровергнуто эмпирически). Я думаю, если бы нам удалось спросить об этом какого-нибудь представителя мейнстрима, то ответ мог бы быть примерно таким же, какой в свое время дал Р. Лукас на вопрос о том, почему экономисты никак не хотят расставаться с вальрасианскими моделями общего равновесия (Lucas, 1986). В самом деле, с институциональной точки зрения эмпирически наблюдаемая рыночная экономика является не чем иным, как сочетанием системы частной собственности с децентрализованным механизмом ценообразования. В то же время вальрасианская модель с аукционистом представляет собой сочетание системы частной собственности с централизованным механизмом установления цен (образно говоря, это — частная собственность плюс Госкомцен). Как заведомо несуществующего персонажа — вальрасианского аукциониста — можно привлекать для описания и объяснения реальной рыночной экономики, где, как мы знаем, формирование цен происходит без его участия? Что

<sup>1</sup> Еще дальше, чем поведенческая экономика, идет нейроэкономика, которая задается вопросом, можно ли считать человеческое поведение рациональным на субиндивидуальном уровне (на уровне отдельных участков головного мозга). Про нее «старые» экономисты, наверное, могли бы сказать, что это — уже не экономика, а биология.

может дать вальрасианская конструкция с ее специфическим институциональным каркасом для понимания системы, которая строится на противоположных институциональных принципах? На этот вопрос Р. Лукас отвечает апелляцией к идее, которую М. де Вроей характеризует как *benign neglect* — что можно перевести как «благотворное (или плодотворное) пренебрежение» (Vroey, 1998). Суть ее сводится к следующему: мы вправе игнорировать это фундаментальное расхождение в базовых институциональных принципах, потому что несмотря на него модели с централизованным механизмом координации позволяют многое понять в функционировании реальной рыночной экономики с децентрализованным механизмом координации; как это становится возможным вопреки столь явной институциональной асимметрии, нас, по большому счету, не должно волновать; достаточно того, что это так, а значит, экономисты поступают правильно, не отказываясь от моделей с вальрасианским аукционистом.

В оправдание допущения о рациональности человеческого поведения представители мейнстрима точно так же могли бы сослаться на идею *benign neglect*. Да, мы знаем, что реальное поведение людей очень часто бывает нерациональным, но все равно не отказываемся от предпосылки рациональности, потому что она позволяет строить операциональные модели и получать с их помощью неплохое описание того, что мы наблюдаем в действительности. Иными словами, как и в случае с вальрасианским аукционистом, пренебрежение реальным положением вещей срабатывает и приносит пользу.

Отсюда видно, что приверженность современных экономистов идее рационального поведения — это не дело принципа, а чистая прагматика. Поэтому, если мы, скажем, способны построить операциональную модель, где одна часть индивидов рациональна, а другая — нет (например, первые исходят из рациональных, а вторые — из адаптивных ожиданий), и если такая модель дает лучшие результаты, то предпочтение будет отдано именно ей.

4. Каноническая модель рационального выбора может использоваться для целей не только позитивного, но и нормативного анализа. Так, в поведенческой экономике она выступает в качестве нормативного идеала, приближение к которому рассматривается как безусловное благо (Thaler, Sunstein, 2008).

В этом смысле ситуация с идеей рациональности напоминает ситуацию с другой базовой идеей — мейнстримной экономической теории — совершенной конкуренции

(Капелюшников, 2016). Современные экономисты склонны отвергать модель совершенной конкуренции в качестве адекватного описания экономической реальности, но одновременно склонны принимать ее в качестве нормативного стандарта — из-за ее предполагаемых *welfare implications*, т.е. следствий с точки зрения благосостояния общества. Поэтому когда они обнаруживают в реальной жизни отклонения от идеала совершенной конкуренции, то обращают свои взоры к государству, призывая его вмешаться, чтобы приблизить фактически существующую ситуацию к гипотетически идеальной.

Точно так же сторонники поведенческой экономики отвергают стандартную модель рационального выбора в качестве адекватной теории, объясняющей принятие решений реальными индивидами, но при этом усматривают в ней нормативный идеал, к которому надлежит стремиться. Соответственно, когда в чем-либо поведении они обнаруживают серьезные отклонения от стандарта полной рациональности, то также устремляют свои взоры к государству в надежде, что оно вмешается и приблизит фактически существующую ситуацию к гипотетически идеальной (Капелюшников, 2016).

5. Хотя представители других социальных дисциплин традиционно критикуют экономистов за догматическую приверженность принципу рациональности, при ближайшем рассмотрении это обвинение оказывается фикцией. В истории экономической науки были целые периоды, когда мейнстримом становились теории, исходившие из представления о глубинной иррациональности человеческой природы. Яркий пример — старое кейнсианство. У самого Дж. М. Кейнса буквально все категории экономических агентов предстают как существа, иррациональные по своей природе: рабочие страдают от денежной иллюзии; потребители движимы склонностью к потреблению, которая не имеет никакого отношения к оптимизирующему поведению; инвесторы подвержены частой смене иррациональных волн оптимизма и пессимизма, и т.д. В этом океане иррациональностей единственным оплотом рации оказывается эксперт-экономист, взявший на вооружение кейнсианскую теорию: только ему с помощью надлежащих советов государству под силу навести в этом всеобщем хаосе разумный порядок. Сходным образом классический монетаризм с его идеей адаптивных ожиданий также допускал, что участники рынка неспособны учиться на своих ошибках и обречены повторять их снова и снова.

В результате на протяжении многих

десятилетий XX в. экономическая наука пребывала в состоянии шизофренической раздвоенности: если действующими лицами в микроэкономике выступали рациональные, то в макроэкономике — нерациональные экономические агенты.

6. Вопрос о том, какое место в экономической теории занимает принцип рациональности, интересовал не только экономистов, но и философов. Пожалуй, особо здесь следует выделить оригинальную трактовку, предложенную в свое время К. Поппером (Popper, 1985).

Он полагал, что в основе не только экономической теории, но и всех прочих социальных дисциплин лежит принцип рациональности, и именно приверженность этому принципу делает их непохожими (в определенных отношениях) на естественные науки. Рациональное поведение понималось Поппером как действия, адекватные (сообразные) ситуации. Отсюда — попперовский термин «ситуационный анализ». Он не отрицал, что в качестве универсального закона принцип рациональности является эмпирически ложным (фальсифицированным): как показывает опыт, люди не всегда действуют так, как того требует ситуация. Тем не менее он считал этот принцип достаточно близким к истине, поскольку чаще всего люди действуют в соответствии с ним.

Согласно К. Попперу в естественных дисциплинах научное объяснение строится следующим образом: если подлежащий объяснению феномен (explanandum) удастся вывести, наложив на типичные исходные условия некий универсальный закон (или одновременно несколько универсальных законов) (explanans), то он считается прошедшим тест на фальсификацию и в этом смысле — объясненным. В социальных дисциплинах ситуация выглядит иначе: в них объяснение строится путем наложения на типичные исходные условия (а к ним в этих дисциплинах относятся цели и знания индивидов) принципа рациональности. При этом сам он рассматривается не в качестве эмпирической теории, подлежащей проверке, а в качестве «нулевого принципа», отправной точки анализа. Даже если исходная гипотеза не находит подтверждения, принцип рациональности никогда не отвергается и считается все равно остающимся в силе: в том случае если гипотеза оказалась фальсифицированной, ответственность за это возлагается не на него, а на другие элементы теории, которые составляют специфику той или иной конкретной модели. Поппер обосновывал эту асимметрию тем, что остальные элементы теории более информативны и инте-

ресны, а также легче тестируемы, чем принцип адекватности наших действий. В результате принцип рациональности оказывается тем обязательным общим элементом, который содержится в любых конкурирующих теориях, пытающихся объяснить социальные явления.

\*\*\*

Как мы видим, исторически отношение экономической науки к принципу рациональности было достаточно амбивалентным. Амбивалентным оно остается и сейчас. С одной стороны, это предположение всегда воспринималось в качестве важнейшей составляющей твердого ядра экономической теории. С другой стороны, экономисты никогда не приписывали ему статуса универсального эмпирического закона. Скорее оно рассматривалось ими как особая методологическая установка, отличающая собственно экономический подход от других возможных подходов к изучению общества.

Тем парадоксальнее выглядит ситуация, сложившаяся в экономической науке во второй половине XX в., когда в макроэкономике доминировало представление о нерациональности (пусть частичной) экономических агентов, а микроэкономика оставалась верной модели рационального выбора, причем поле приложения этой модели непрерывно расширялось. В последние десятилетия роли в каком-то смысле поменялись: макроэкономический анализ предпочитает иметь дело с рациональными экономическими агентами, а в микроэкономическом анализе все более заметен интерес к различным формам иррационального поведения.

Хотя в последние десятилетия позиции принципа рациональности как в теоретических, так и в эмпирических исследованиях оказались подорваны, маловероятно, что это приведет к утрате им своего традиционного статуса в качестве базового методологического ориентира для экономического анализа. Причина достаточно проста: трудно представить, как могла бы выглядеть общая теория иррационального поведения, сравнимая по широте, полноте и степени структурированности с канонической моделью рационального выбора. Как показывает пример поведенческой экономики, исследование поведенческих аномалий неизбежно распадается на анализ множества никак не связанных между собой частных случаев. Можно поэтому ожидать, что и в будущем методологический фундамент экономической науки будет состоять из центра в виде принципа рациональности и периферии в виде многочисленных отступлений от него.

## ЛИТЕРАТУРА

- Капелиушников Р.И.** (2016). Экономические очерки: методология, институты, человеческий капитал. М.: Изд. дом НИУ ВШЭ.
- Мизес Л.** (2000). Человеческая деятельность. Трактат по экономической теории. М.: Экономика.
- Alchian A.A.** (1950). Uncertainty, Evolution, and Economic Theory // *Journal of Political Economy*. Vol. 58. No. 3. P. 211–221.
- Becker G.S.** (1962). Irrational Behavior and Economic Theory // *Journal of Political Economy*. Vol. 70. No. 1. P. 1–14.
- Lucas R.J. jr.** (1986). Adaptive Behavior and Economic Theory // *Journal of Business*. Vol. 59. P. 401–426.
- Popper K.** (1985). The Rationality Principle. In: “*Popper Selections*”. Miller D. (ed.). Princeton: Princeton University Press. P. 357–365.
- Smith V.** (2003). Constructivist and Ecological Rationality in Economics // *American Economic Review*. Vol. 93. No. 3. P. 465–508.
- Thaler R.H., Sunstein C.R.** (2008). *Nudge: Improving Decisions about Health, Wealth and Happiness*. New Haven and London: Yale University Press.
- Vroey M. de** (1998). Is the Tâtonnement Hypothesis a Good Caricature of Market Forces? // *Journal of Economic Methodology*. Vol. 5. No. 2. P. 201–221.

Поступила в редакцию 15 января 2017 года

## REFERENCES (with English translation or transliteration)

- Alchian A.A.** (1950). Uncertainty, Evolution, and Economic Theory. *Journal of Political Economy*, 58, 3, 211–221.
- Becker G.S.** (1962). Irrational Behavior and Economic Theory. *Journal of Political Economy*, 70, 1, 1–14.
- Kapeliushnikov R.** (2016). *Economic Essays: Methodology, Institutions, Human Capital*. Moscow: HSE Publishing House (in Russian).
- Lucas R.J. jr.** (1986). Adaptive Behavior and Economic Theory. *Journal of Business*, 59, 401–426.
- Mises L.** (1996). *Human Action. A Treatise on Economics*. Chicago: Contemporary Books Inc. (in Russian).
- Popper K.** (1985). The Rationality Principle. In: “*Popper Selections*”. Miller D. (ed.). Princeton: Princeton University Press, 357–365.
- Smith V.** (2003). Constructivist and Ecological Rationality in Economics. *American Economic Review*, 93, 3, 465–508.
- Thaler R.H., Sunstein C.R.** (2008). *Nudge: Improving Decisions about Health, Wealth and Happiness*. New Haven and London: Yale University Press.
- Vroey M. de** (1998). Is the Tâtonnement Hypothesis a Good Caricature of Market Forces? *Journal of Economic Methodology*, 5, 2, 201–221.

Received 15.01.2017

## R.I. Kapeliushnikov

Institute of World Economy and International Relations. Russian Academy of Sciences;  
National Research University – Higher School of Economics, Moscow, Russia

## Status of Rationality Principle in Economics: Past and Present

**Abstract.** The paper provides a short overview of different applications of rationality principle in economics. Author argues that although in the last decades the role of rationality principle was substantially undermined in both empirical and theoretical studies. It is likely to preserve its traditional status as a basic methodological guide for economic analysis.

**Keywords:** *behavioral economics, methodology, rational choice, rationality principle.*

JEL Classification: A12, B41, D01, D03.