

И. М. Рисованный

## ЭВОЛЮЦИОННАЯ ИНСТИТУЦИОНАЛЬНАЯ МИКРОЭКОНОМИКА: РАЗМЫШЛЕНИЯ НАД КНИГОЙ

В прошлом году издательство «Дело» опубликовало книгу американского экономиста, профессора С. Боулза «МИКРОЭКОНОМИКА. Поведение, институты и эволюция» [1], которая вызвала вполне положительные, хотя и неоднозначные отклики.

Сказать кратко об исследовании американского экономиста, профессора С. Боулза весьма затруднительно, настолько оно фундаментально, насыщено богатым эмпирическим материалом (объем книги более 500 страниц, распределенных по 14 главам), при изучении которого используются разнообразные аналитические инструменты (модели). Ограничимся наиболее существенными идеями, приемами анализа и заключениями, относящимися к главной теме — предпочтения и институты и их совместная эволюция.

### Типовые социальные взаимодействия: предпочтения и институты

Как это часто бывало в истории экономической науки, предлагаемая работа базируется на критике доминирующей парадигмы и введении новых предпосылок и подходов. В данном случае критике подвергается неоклассическая экономическая теория, лежащая в основании современной микроэкономики (вальрасовская парадигма), ставящая во главу угла индивидуальные предпочтения и описывающая экономическое поведение экономических агентов «в виде решения оптимизационной задачи с ограничениями, которое осуществляет совершенно информированный индивид в пространстве, фактически лишенном институтов». Такая «презентация», конечно, карикатурна и отнюдь не нова, что признает и сам Боулз [1, с. 8].

В поисках более подходящего объяснения поведенческих основ экономики С. Боулз отталкивается от некоторых эмпирически наблюдаемых фактов, характеризующих типовые структуры взаимодействий между людьми и их индивидуальное поведение. Во-первых, люди одновременно *неоднородны* (одни склонны учитывать собственные интересы, другие — общественные) и *адаптивны*, т. е. чаще приспосабливаются к текущей ситуации, нежели следуют единой целенаправленной поведенческой схеме. Во-вторых, повсеместно распространенными (в семьях, фирмах, общинах, на рынках, в политических проектах) являются *неконтрактные* социальные взаимодействия, которые управляются комбинацией норм и власти. В-третьих, социальные взаимодействия зачастую приводят к результатам, которые являются следствием институциональной дополняемости (институциональной синергии) и обозначаются термином «обобщенная возрастающая отдача» [1, с. 9–13].

---

Иван Михайлович РИСОВАННЫЙ — канд. экон. наук, доцент кафедры экономической теории СПбГУ. В 1970 г. окончил экономический факультет СПбГУ. В 1974 г. защитил кандидатскую диссертацию. Сфера научных интересов — макроэкономика, институциональная экономика. Автор более 50 публикаций, в том числе 2 монографий.

© И. М. Рисованный, 2012

Исходя из этих посылок, автор формулирует поведение индивидов как «социальные предпочтения» — ситуационно специфические причины поведения *адаптивных агентов*, подчиняющихся правилам, действующих с *оглядкой на других и на процесс* (т. е. их оценка состояния вещей зависит от того, как оно оценивается другими и как это состояние достигнуто) и в условиях *обобщенной возрастающей отдачи* [1, с. 93, 99, 105]. Подход к предпочтениям, долгосрочную основу которых обеспечивают социальные нормы (включая этические предписания альтруизма, справедливости, вкусов и мнений, внутренние реакции), отличается от привычного *когнитивно-ориентированного* подхода, объясняющего индивидуальное поведение *свокорыстными предпочтениями* [1, с. 92–93].

Переформулировка поведенческого контекста с позиций социальных предпочтений делает необходимым пересмотр и уточнение традиционных принципов микроанализа, таких как методологический индивидуализм, рациональность, полезность, равновесие.

Автор не против *методологического индивидуализма* (метода, описывающего явления на групповом уровне, включая институты, с позиции действий индивидов), но дополняет его обратным эффектом воздействия агрегированных исходов (институтов) на предпочтения индивидов как носителей поведенческих норм [1, с. 58, 454].

Основываясь на ситуационно зависимом поведении, автор вводит понятие *ситуационной полезности*; функция полезности должна учитывать аргументы не состояния, но *изменения в состояниях или события* [1, с. 103–104].

С точки зрения Боулза, *рациональность* необязательно подразумевает эгоистический интерес; транзитивными и полными могут быть альтруистические или мазохистские предпочтения. «Люди сознательно преследуют свои цели, но чаще делают это, основываясь на знакомых им по прошлому опыту поведенческих ответах»; зачастую они «идут на ухудшение собственного благосостояния не только ради улучшения благосостояния других, но и ради наказания тех, кто ... нарушил этические нормы ... Люди ведут себя великодушно по отношению к тем, кто вел себя доброжелательно (по отношению к ним или к кому-то еще) и наказывают тех, кто вел себя недоброжелательно» (мотив «реципрокности») [1, с. 10, 92].

Если в вальрасовской парадигме индивидуальное поведение в состоянии *равновесия*, так же как и агрегированные свойства данного равновесия, стационарны, то при поствальрасовском подходе стационарность агрегированных свойств не предполагает стационарности объектов нижнего уровня (т. е. индивидов). Агрегированные исходы могут быть средними (за долгий промежуток времени) значениями нестационарных значений [1, с. 455].

Поскольку социальные нормы создают стимулы и ограничения, результирующие агрегированные последствия индивидуальных взаимодействий, то предпочтения *эндогенны* по отношению к институтам. «Мы приобретаем предпочтения путем генетического наследования и культурного обучения; те и другие подвержены влиянию экономических и прочих институтов» [1, с. 356].

В свою очередь, функционирование институтов связано с предпочтениями вовлеченных индивидов (последние являются носителями поведенческих норм), и предпочтения определяют, какие институты доступны и имеют шанс сохраниться, т. е. институты также *эндогенны* [1, с. 58, 120, 383].

Объясняя постановку вопроса, Боулз пишет: «Для задач, использующих определенные аналитические методы, иногда разумно предполагать институциональную среду заданной... Однако если нас интересует процесс институциональной эволюции, то мы должны изображать институты не как экзогенно заданные ограничения, но скорее как исход индивидуальных взаимодействий... исследовать взаимодействие, в ходе которого данный институт появился» [1, с. 351–352].

Взаимная эндогенность предпочтений и институтов обуславливает их эндогенную эволюцию. Взаимодействия тех и других, их совместная динамика — с учетом неоднородности, изменчивости и гибкости — является предметом эволюционного моделирования, что и составляет центральную тему исследования Боулза [1, гл. 2, 11–13].

### Институциональная и поведенческая эволюция

Мы изучаем индивидуальное поведение в основном для того, чтобы понять агрегированный результат. Согласно вальрасовской модели общего равновесия, при наличии определенных условий (четко определенные права собственности, конкурентный рынок и т. п.) можно объединить индивидуальные действия производителей и потребителей для получения общего уровня цен, выпуска и распределения ресурсов между различными целями. В таком случае говорят о достижении Парето-эффективного конкурентного равновесия. По мнению Боулза, для объяснения агрегированных результатов этого недостаточно: необходимо учитывать эффект обратной связи, строить модели на уровне популяции, в которых связывались бы индивидуальные действия с общими для всего населения исходами, и рассматривать процессы с учетом фактора времени, т. е. в динамике.

Такого рода решения автор демонстрирует на моделях, использующих объяснительный потенциал, применяемый для описания биологических систем (наследование, естественный отбор, случайность), с одним существенным уточнением: люди вводят институциональные инновации (аналог «видообразования» в биологии) намеренно и зачастую коллективно, а не просто случайно [1, с. 56–57].

Отличительные характеристики эволюционного подхода к экономике включают моделирование случайностей, дифференциальной репликации, внеравновесной динамики и структуры популяции.

*Репликация* (аналог «естественного отбора») — копирование и распространение институциональных и поведенческих характеристик. Поскольку популяции структурированы, то репликации могут происходить на разных уровнях; *дифференциальная репликация* — групповой или многоуровневый отбор предпочтений и институтов [1, с. 59].

С учетом фактора времени процесс дифференциальной репликации приобретает характер *неравновесной динамики* (т. е. динамики вне равновесия). Явный учет неравновесной динамики и существования «нерелевантных» равновесий (т. е. не соответствующих смыслу равновесия) является важнейшей характеристикой эволюционного подхода, принципиально отличного от традиционного подхода сравнительной статистики и стандартной статической модели рыночного равновесия [1, с. 61].

*Случайность* в эволюционных моделях эндогенна, она может приобретать форму наследуемой инновации или являться результатом поведенческих инноваций, не передаваемых генетически. Случайность играет важную роль в социальной динамике: при наличии обобщенной возрастающей отдачи даже незначительные маловероятные события («шоки») оказывают существенное и продолжительное воздействие на равновесные состояния, влияют на направление и скорость эволюционных изменений [1, с. 59].

Боулз тестирует эволюционный подход к развитию предпочтений и институтов на моделях, в основе которых лежит эволюционная теория игр, где игра — способ моделирования стратегических взаимодействий, т. е. ситуаций, в которых последствия индивидуальных действий зависят от того, что предпринимают другие, и эта взаимозависимость осознается всеми вовлеченными сторонами. В своем анализе Боулз использует различные формы игр (кооперативные и некооперативные игры, игры, завязанные «на общем интересе либо конфликте интересов», и др.) и концепции поиска решений (доминирование, равновесие по Нэшу) [1, с. 30–52].

Смысл *доминирования* заключается в том, чтобы выяснить, чего не случится (или что точно случится) в игре; доминирующей является наилучшая стратегия из всего множества доступных агенту стратегий вне зависимости от того, какие стратегии выбирают другие агенты.

Как доминирование, так и равновесие по Нэшу основаны на понятии стратегии *наилучшего ответа*. Идея, лежащая в основе *равновесия по Нэшу* (неоптимального по Парето исходу) заключается в том, что может существовать одно или более решений, в которых ни один игрок не будет иметь стимулов изменить свою стратегию в течение длительного времени при данных стратегиях, выбранных другими игроками [1, с. 31].

Чтобы понять, какое из многих равновесий по Нэшу будет установлено, требуются информация об изначальных условиях и анализ внеравновесного поведения. Причем понятия «историческая случайность» и «динамика (включая обучение)» представляют собой необходимые дополнения в данной концепции [1, с. 51].

Одна из особенностей экономической теории игр заключается в том, что институты трактуются как *исходы* индивидуальных взаимодействий (исходы игры), и поведение индивидов (игроков) меняется в процессе обучения.

Вначале используется стохастическая эволюционная теория игр, в которой учитывается важность случайных событий. На этой основе строится модель *культурной эволюции*, которая демонстрирует изменение предпочтений в ответ на институциональные различия, посредством культурного обучения (переноса культурных признаков) на собственном опыте или опыте других, а изменение институтов — в результате экзогенных технологических шоков.

«Процессы культурного переноса... возникли, скорее всего, *сами по себе* под воздействием естественного отбора, культурного группового отбора, случая и других эволюционных давлений» [1, с. 357]. Переносчиками культурных признаков (т. е. любых характеристик индивида или группы, которые другие могут воспринять, сохранить или отвергнуть) являются индивиды, а дифференциальная репликация происходит посредством приобретения признаков (норм), принесших успех другим. При этом возможен процесс «конформистского переноса», с применением силы со стороны третьих лиц, например государства, классов или организаций [1, с. 67–68].

Если институты выступают исходами индивидуальных взаимодействий и способом их описания являются соглашения, то процесс институциональных изменений предстает как переход от одного исхода к другому, и они изображаются как смена одних соглашений другими [1, с. 46]. Тогда анализ институциональных изменений (инноваций) становится проблемой выбора устойчивого равновесия (равновесия по Нэшу), т. е. нахождения причин, почему именно такое равновесие реализуется и поддерживается, тогда как возможны и другие равновесия [1, с. 352].

Для объяснения смены институтов в этой модели вводятся понятия наилучших (оптимальных) и ненаилучших (неоптимальных) ответов: первые устремляют агентов к одному из равновесных устойчивых состояний, вторые соответствуют специфическим действиям, нарушающим данное равновесие и приводящим к переходу от одного соглашения к другому [1, с. 391].

Боулз строит расширенную стохастическую эволюционную модель, интегрирующую случай и координированные коллективные действия групп индивидов, желающих смены институтов. С его точки зрения, к эволюционным институциональным изменениям приводят два процесса. Во-первых, появление *внутри* общества большого числа индивидов, которые действуют с нарушением соглашения, что в результате приводит к его смене. Этот процесс может принимать форму конфликта между сторонами («разрыва с прошлым»), которые в разной степени оказываются в выигрыше (как в истмате Маркса), но может происходить постепенно, за счет адаптации институтов к новым требованиям и возможностям (внутригрупповая динамика, побуждающая общество к смене соглашения, моделируется в гл. 12).

Во-вторых, конкуренция *между группами*, которыми руководят различные институты (модель группового или многоуровневого отбора в гл. 13).

В первом случае причинный механизм выбора равновесия заключается в концентрации ненаилучших ответов, во втором — трансформация институтов происходит в совместном процессе межгрупповой конкуренции и перехода внутри группы от одного соглашения к другому.

«Изменения происходят из-за накопления случайных специфических ненаилучших ответов индивидов. Иногда этого достаточно, чтобы переломить лежащий в основе динамический процесс от области притяжения одного устоявшегося равновесия к другому» [1, с. 386]. С другой стороны, выбор ненаилучших ответов является скорее преднамеренным, нежели случайным, он приобретает форму коллективных действий, а не некорректированного поведения индивидов [1, с. 354, 411]. Причем в случае конформистского переноса культурных признаков представитель популяции совершит ненаилучший выбор тем вероятнее, чем больше его соратников поступят так же. Это приводит к большей концентрации *специфических действий* и может ускорить процесс перехода [1, с. 414].

*Групповой отбор* — процесс распространения норм, который происходит из-за успеха групп, в которых приверженность этим нормам общепринята [1, с. 228].

*Многоуровневый отбор* — процесс, в котором эволюция индивидуальных характеристик находится под влиянием давления конкуренции как на уровне индивидов, так и на более высоком уровне [1, с. 427].

Таким образом, в эволюционной модели Боулза существуют три фундаментальных источника институциональных изменений: приспособление к экзогенно заданным правилам поведения (технологические изменения, или то, что у Маркса называется «материальные производительные силы»); совместное влияние случайных событий; коллективные действия и конкуренция между группами популяции [1, с. 387, 445].

Данная модель позволяет прояснить феномен инерции институтов и существования так называемых эволюционных универсалий. С точки зрения Боулза, концентрация ненаилучших ответов работает как инструмент выбора равновесия для такого рода институтов, и это является причинным механизмом, объясняющим их успех [1, с. 411].

Примерами институтов — эволюционных универсалий, возникающих и существующих с завидным постоянством независимо друг от друга в совершенно разных средах и в обстоятельствах, подтвердивших свою эволюционную жизнеспособность, могут служить: деньги, рынки, государства, собственность, демократия, поклонение сверхъестественным существам и др. [1, с. 385].

Боулз характеризует такие институты как стохастические устойчивые и доступные «робастные» соглашения (robust — прочный), особенность которых заключается в том, что для выхода из них требуется большое число специфических действий и малое — для прихода; к ним «легко прийти, но тяжело покинуть» [1, с. 392–393, 400].

### О «хорошем управлении» и «хорошей политике»

Завершая исследование (гл. 14), Боулз приводит сравнительный анализ трех основных институтов, играющих особую роль в решении проблемы координации, — рынков, государств и общин. Показанные им преимущества и недостатки этих институтов известны из других работ, однако автор дополняет их рядом существенных дополнительных аргументов.

Боулз подчеркивает позитивную роль рынков в сфере некооперативных взаимодействий: раскрытие информации в процессе ценообразования и относительно бескоррупционный механизм, давление отбора, способствующего росту производственной эффективности [1, с. 461].

Государство способно смягчать провалы координации, устанавливая и поддерживая универсальные правила игры, по которым происходит взаимодействие частных агентов, в том числе побуждать их взаимодействовать в тех случаях, когда разобщенные действия неэффективны [1, с. 462].

К достоинствам общин автор относит такие средства регулирования совместной деятельности, как доверие, солидарность, взаимность, месть, воздаяние и др. [1, с. 465–466].

Недостатки отмеченных институтов являются обратной стороной их достоинств.

Практические рекомендации относительно «хорошего управления» и «хорошей политики» сводятся к двум положениям.

Во-первых, большинство экономических взаимодействий управляются неоднородным набором формальных и неформальных правил, отражающих аспекты рынков, государств и общин; некоторые комбинации работают лучше других. Дополняемость этих институтов может стать надеждой для мобилизации неоднородных и разнообразных возможностей и мотивов людей, чтобы лучше использовать потенциал расширяющегося знания к повышению благосостояния общества [1, с. 469, 476]. Другими словами, должно быть много разных институтов.

Во-вторых, институты и политика не есть просто инструменты, готовые к применению «благонамеренными слугами общества», скорее они представляют собой продукты как эволюции, так и конструирования, и, в свою очередь, подвержены провалам координации [1, с. 53]. Для достижения эффективности в государственной политике важно, чтобы учитывался динамический характер системы, в которую вмешивается. «Политика, направленная на замену социально нежелательного равновесия в пользу некоторого другого исхода, может сильно различаться, когда система характеризуется единственным равновесием или существует несколько устойчивых равновесий» [1, с. 457].

Исследование С. Боулза рекомендовано ГУ–ВШЭ в качестве учебника для студентов, аспирантов и преподавателей экономических факультетов вузов. Появились и первые вполне положительные, хотя и неоднозначные отклики (см. [2, с. 116, 122]).

В монографии Боулза есть много верных наблюдений и справедливых замечаний, прежде всего относительно микроэкономики. Новизна заключается в вовлечении предпочтений экономических агентов в широкий институциональный контекст: предпочтения и институты — движущие силы экономических процессов, они не постоянны и подвержены совместной эволюции, изменения происходят под воздействием социальных и политических сил.

Переформулировка предпосылок поведенческих основ экономики с учетом институционального «дизайна» и динамики предпочтений и институтов — все это расширяет рамки предмета микроэкономики, делает более реалистичным понимание поведенческих структур в долгосрочной перспективе. Одновременно это вызывает необходимость пересмотра методологии анализа в пользу эмпирического метода и эволюционного подхода.

Эмпирический метод (в отличие от дедуктивного) требует подтверждения предпосылок опытным путем, предполагает описание типов поведения, детерминированных различными мотивами, сведение их к своим исходам.

Эволюционный подход к изучению динамики институтов в связи с динамикой предпочтений, как альтернатива «конституционному порядку», предполагает использование соответствующих эволюционных моделей («неоднородных» и «адаптивных») и всевозможных компьютерных симуляций социальных взаимодействий.

Читатель должен знать не только теорию экономического равновесия Вальраса — Парето — Маркса — Самуэльсона или основы институциональной экономики, ему необходимо иметь представления о теории игр и линейном программировании. В результате анализ (как и преподавание) проблем: *что, как и для кого* производить, *что, сколько и по какой цене* приобретать (причем то и другое в обозримой, а не в долгосрочной перспективе) усложняется.

С. Боулз ставил своей задачей изучить влияние экономических институтов на благосостояние людей, используя эволюционный подход. В частности, он поддерживает гипотезу, согласно которой те страны, где власти использовали «специфические институты», ограничивающие доступ к земле, возможностям предпринимательства, сбережениям и инвестициям и т. д., оказывались менее успешными в долгосрочной перспективе, чем те, которые делали ставку на «менее специфические институты», поощрявшие отмеченные устремления к экономическому росту.

Актуализируя взаимосвязь институтов и предпочтений в процессе их совместной эволюции, указывая на роль культурной эволюции, коллективных действий, межгрупповых конфликтов и т. д., автор вносит вклад в институциональную экономику, девиз которой — «институты определяют отдачу». Он расширяет представление о причинных механизмах возникновения институциональных инноваций и инерции институтов, тем самым дополняет и уточняет известную схему институциональных изменений (Демсетца — Норта), понимание природы «зависимости от траектории предшествующего развития» и «эффекта блокировки».

Исследование Боулза представляет, по сути, «институциональную микроэкономику», претендующую на всеобъемлющую теорию выбора поведенческих структур, независимо от сфер приложения — будь то экономика, политика или обычаи бинтования ступней девочек в Китае и «женского обрезания» в Судане [1, с. 12, 350, 415]. Его усилия

придать микроэкономике статус «эволюционной социальной науки» можно рассматривать как очередной шаг на пути реализации давней идеи создания «обобщенной экономической теории». Перспективы такой теории (если следовать эволюционному подходу) во многом будут зависеть от того, насколько она как институциональная инновация обладает свойством «обобщенной возрастающей отдачи» и в состоянии вытеснить традиционную парадигму.

Современное российское общество представляет собой континуум, изобилующий процессами и явлениями, подтверждающими сложный характер институциональных изменений. Если на протяжении практически всего XX столетия казалось, что социальные взаимодействия регулируются исключительно методами «социальной инженерии», то к концу и особенно в начале нового века — благодаря случайным событиям, процессам культурного переноса, внутригрупповой конкуренции, социальным предпочтениям, формирующимся при помощи новых информационных технологий, и т. п. — все отчетливее проявляется их эволюционный характер. Структура социальных взаимодействий в переходной экономике России близка к институциональной микроэкономике Боулза, но предпочтения экономических агентов во многом ориентируются (как ориентировались и прежде в условиях централизованно управляемой системы) и на принципы «ортодоксальной» микроэкономики. Этому способствуют многие факторы, в том числе недоверие к институтам современной власти, отсутствие реальной конкуренции в политической и экономической сферах жизни, традиционно слабая способность граждан к кооперации и коллективным действиям.

Исследование С. Боулза может быть по-разному воспринято среди отечественных экономистов-институционалистов. Для одних идея совместной эволюции эндогенных предпочтений и институтов придаст аргументов, дополняющих «конституциональную» парадигму социальной динамики, для других — послужит оправданием давления традиции и использования «специфических институтов», провоцирующих бесконечный поиск «особого» пути институциональной модернизации России.

## Литература

1. Боулз С. Микроэкономика. Поведение, институты и эволюция: учебник / пер. с англ. М.: Изд-во «Дело АНХ», 2011. 576 с.
2. Обсуждаем микроэкономике С. Боулза // Вопросы экономики. 2011. № 8. С. 114–126.

Статья поступила в редакцию 5 марта 2012 г.