

С Е Р И Я  
Э К О Н О М И Ч Е С К А Я  
Т Е О Р И Я

UNDERSTANDING  
THE PROCESS  
of ECONOMIC  
CHANGE

DOUGLASS C. NORTH

# ПОНИМАНИЕ ПРОЦЕССА ЭКОНОМИЧЕСКИХ ИЗМЕНЕНИЙ

ДУГЛАС НОРТ

*Перевод с английского*  
КИРИЛЛА МАРТЫНОВА  
НИКОЛАЯ ЭДЕЛЬМАНА



*Издательский дом*  
*Государственного университета — Высшей школы экономики*  
МОСКВА, 2010

УДК 330.341.2

ББК 65.01

Н83

*Составитель серии*

ВАЛЕРИЙ АНАШВИЛИ

*Дизайн серии*

ВАЛЕРИЙ КОРШУНОВ

*Научный редактор*

АРТЕМ СМИРНОВ

**Норт, Д.**

Н83 Понимание процесса экономических изменений [Текст] / пер. с англ. К. Мартынова, Н. Эдельмана; Гос. ун-т — Высшая школа экономики. — М.: Изд. дом Гос. ун-та — Высшей школы экономики, 2010. — 256 с. — (Экономическая теория). — 1000 экз. — ISBN 978-5-7598-0754-4 (в пер.).

В настоящей работе лауреат Нобелевской премии по экономике Дуглас Норт (род. 1920) предлагает новый подход к пониманию процесса экономических изменений. Исходя из представления о том, что экономический рост зависит главным образом от качества институтов, обеспечивающих существование рынков, гарантии прав собственности и низкие транзакционные издержки, автор показывает, как различные общества приходят к различной институциональной инфраструктуре, которая во многом определяет траектории их экономического развития. Норт утверждает, что экономические изменения зависят от способности общества создавать производительные, стабильные, честные, общепризнанные и в то же время гибкие институты, способные меняться в ответ на изменение политической и экономической обстановки. Не отказываясь от своего более раннего определения институтов как формальных и неформальных правил, ограничивающих экономическое поведение, автор рассматривает и более глубокие условия развития этих правил и изменения экономик.

УДК 330.341.2

ББК 65.01

ISBN 978-5-7598-0754-4

All rights reserved. No part of this book may be reproduced or transmitted in any form or by any means, electronic or mechanical, including photocopying, recording or by any information storage and retrieval system, without permission in writing from the Publisher.

© Princeton University Press, 2005

© Оформление. Издательский дом Государственного университета — Высшей школы экономики, 2010

# СОДЕРЖАНИЕ

ПРЕДИСЛОВИЕ .....	7
I. КРАТКИЙ НАБРОСОК ПРОЦЕССА ЭКОНОМИЧЕСКИХ ИЗМЕНЕНИЙ .....	13
ЧАСТЬ ПЕРВАЯ. ПРОБЛЕМЫ, СВЯЗАННЫЕ С ПОНИМАНИЕМ ПРОЦЕССА ЭКОНОМИЧЕСКИХ ИЗМЕНЕНИЙ .....	25
ВВЕДЕНИЕ .....	25
II. НЕОПРЕДЕЛЕННОСТЬ В НЕЭРГОДИЧЕСКОМ МИРЕ .....	26
III. СИСТЕМЫ УБЕЖДЕНИЙ, КУЛЬТУРА И КОГНИТИВНАЯ НАУКА .....	42
IV. СОЗНАНИЕ И ИНТЕНЦИОНАЛЬНОСТЬ ЧЕЛОВЕКА .....	63
V. СТРОИТЕЛЬНЫЕ ЛЕСА, ВОЗВОДИМЫЕ ЛЮДЬМИ .....	77
VI. ПОДВЕДЕНИЕ ИТОГОВ .....	101
ЧАСТЬ ВТОРАЯ. ПУТЬ В БУДУЩЕЕ .....	124
ВВЕДЕНИЕ .....	124
VII. ЭВОЛЮЦИЯ ЧЕЛОВЕЧЕСКОЙ СРЕДЫ .....	128
VIII. ИСТОЧНИКИ ПОРЯДКА И БЕСПОРЯДКА .....	148
IX. ПРИЧИНЫ УСПЕХОВ И ПРОВАЛОВ .....	166

Х. ТРИУМФ ЗАПАДНОГО МИРА . . . .	182
ХІ. ВЗЛЕТ И ПАДЕНИЕ СОВЕТСКОГО СОЮЗА . . . . .	209
ХІІ. ПОВЫШЕНИЕ ЭКОНОМИЧЕ- СКОЙ ЭФФЕКТИВНОСТИ . . . . .	222
ХІІІ. КАМО ГРЯДЕШИ? . . . . .	237
 ЛИТЕРАТУРА . . . . .	 244

## ПРЕДИСЛОВИЕ

Понимание процесса экономических изменений позволит нам объяснить, почему экономики мира в прошлом и настоящем демонстрировали столь различную эффективность. Мы сможем понять, в чем заключались причины непрерывного экономического роста в США и Западной Европе, яркого взлета и столь же стремительного падения Советского Союза, разительного контраста между энергичным экономическим развитием Тайваня и Южной Кореи и отсутствием успехов в странах Африки южнее Сахары, почему столь разными путями шла эволюция Латинской Америки и Северной Америки. Помимо понимания прошлого, такие знания послужат ключом к повышению экономической эффективности в настоящем и будущем. Реальное понимание экономического роста открывает путь к еще большему росту благосостояния и преодолению нищеты и лишений.

Экономическая парадигма — неоклассическая теория — создавалась не для того, чтобы объяснить процесс экономических изменений. Мы живем в мире неопределенности и непрерывных изменений, эволюция которого все время идет по новым и неожиданным путям. Стандартные теории в этих условиях едва ли на что-нибудь годятся. Попытка разобраться в экономических, политических и социальных изменениях (притом что невозможно изучать изменения в одной из этих сфер в отрыве от прочих) требует фундаментальной перестройки нашего образа мысли. Удастся ли нам создать динамичную теорию изменений, сопоставимую по своему изяществу с теорией общего равновесия? Вероятно, следует ответить — «нет». Но если мы сможем прийти к пониманию скрытого процесса изменений, то, видимо, у нас появится возможность вы-

двигать более конкретные гипотезы в отношении изменений, которые могут колоссально повысить пользу общественно-научных теорий при решении проблем, с которыми сталкивается человечество.

Настоящее исследование представляет собой развитие — очень существенное развитие — новой институциональной экономики. Его масштабы позволят должным образом оценить краткий обзор моих прежних работ об институциональных изменениях. Уже в самых первых исследованиях, написанных совместно с Лэнсом Дэвисом [Davis and North, 1971] и Робертом Томасом [North and Thomas, 1973], я рассматривал институты как ключ к пониманию экономики, потому что они создают структуру экономических стимулов. Кроме того, я изучал, чем объясняется существование экономик, состоящих из институтов, которые создают стимулы к стагнации и упадку. Скрытым источником такой устойчивости должны быть какие-то черты людского окружения и то, каким образом люди его воспринимают. В моих предыдущих исследованиях не учитывался характер социетальных изменений и то, каким образом люди понимают его и как это понимание влияет на их действия.

Экономические изменения — это процесс, и в данной книге я опишу природу этого процесса. В противоположность дарвиновской эволюционной теории, ключом к эволюционным изменениям человечества является интенциональность игроков. На механизмы отбора в эволюционной теории Дарвина не влияют представления о конечных результатах. Напротив, эволюция человеческого общества направляется представлениями игроков; выбор совершается в свете этих представлений с намерением добиться результатов, снижающих неопределенность, с которой сталкиваются организации — политические, экономические и социальные, — преследуя свои цели. Поэтому экономические изменения по большей части являются сознательным процессом, формируемым представле-

ниями участников о последствиях их действий. Источником этих представлений служит то, во что игроки верят: теории, предсказывающие последствия их поступков и обычно неотделимые от их предпочтений.

Но каким образом люди приходят к пониманию своего окружения? Выдвигаемые ими объяснения представляют собой ментальные конструкторы, основанные на опыте, как современном, так и историческом. Процесс обучения — это нечто большее, чем накопление индивидуумом опыта в течение своей жизни. Помимо этого, обучение включает в себя совокупный опыт прошлых поколений. Совокупные знания общества, воплощенные в языке, человеческой памяти и системах хранения символов, состоят из верований, мифов, обычаев, которые составляют культуру общества. Культура не только определяет эффективность общества в данный момент времени, но также посредством того, как выстроенные на ней структуры создают сдержки для игроков, вносит свой вклад в процесс изменений. Поэтому основное внимание мы должны уделить вопросу обучения — выяснить, чему учатся люди, как выученные знания распространяются по всему обществу, разобраться в процессе постепенного изменения представлений и предпочтений и в том, как эти изменения сказываются на экономической эффективности.

Отчасти выстроенные людьми структуры представляют собой эволюционный результат успешных мутаций, тем самым входя составной частью в генетическую структуру человека: сюда, например, относится врожденная склонность к сотрудничеству в маленьких взаимодействующих группах; другая часть этого наследия — результат культурной эволюции, выражающейся, в частности, в развитии институтов, способствующих сотрудничеству более крупных групп. Какая именно доля приходится на генетическую структуру, а какая — на культурное наследие, вопрос спорный. Психологи-эволюционисты делают упор на генетиче-

ской структуре, принижая роль культурного наследия. Некоторые характерные черты ментальных конструкций, созданных людьми (такие как сверхъестественные объяснения, то есть религии в широком смысле), наводят на мысль, что они обусловлены скрытыми структурами мышления, присущими всем людям. Равным образом колоссальные различия в характеристиках эффективности различных обществ ясно говорят о том, что культурный компонент воздвигнутого людьми здания также является ключевым фактором, определяющим эффективность известных из истории экономик и государств.

Наблюдаемый в течение всей человеческой истории разрыв между намерениями и результатами отражает хронические противоречия между подмостками, которые люди строят для наблюдения за своим окружением, и непрерывно изменяющейся «реальностью» этого окружения. Эти противоречия и их последствия для условий человеческого существования в прошлом, настоящем и, разумеется, будущем и служат темой нашей книги. В первой части будут рассмотрены разные стороны вызова, связанного с приобретением углубленных познаний о процессе экономических изменений. Вторая часть представляет собой экскурс в прошлое, предпринятый в целях более глубокого понимания.

Нам не удастся построить пригодную модель экономических изменений, если мы не будем понимать их процесс. Хорошая модель включает в себя предварительное осознание сложных факторов, из которых складывается этот процесс, и их последующее сознательное упрощение ради выделения ключевых элементов. Понимание — необходимая предпосылка, которой не хватает экономисту, стремящемуся создать модель экономического роста и экономических изменений. Нам еще далеко до полного понимания этого процесса, и до тех пор, пока мы не пройдем путь до конца, нам не видать серьезных успехов в деле повышения экономической эффективности. Нижеследующее пред-

ставляет собой попытку приблизиться к такому пониманию.

Данное исследование потребовало для своего завершения большого времени — более десяти лет — и оказалось бы невозможно без щедрой помощи со стороны многих организаций и лиц.

И Вашингтонский университет, место моего постоянного обитания, и Институт Гувера в Стэнфорде, моя зимняя резиденция, создали благоприятную обстановку для проведения работы. Центр Меркатуса при Университете Джорджа Мэйсона и Стэнфордский институт международных исследований принимали у себя конференции по темам, освещающимся в данной книге, и я выражаю глубокую признательность Полу Эдвардсу и Брайну Хуксу из Центра Меркатуса, а также Сайеду Шарикуну, игравшему ключевую роль при организации конференций в Стэнфорде.

Мои коллеги по Вашингтонскому университету терпеливо отвечали на мои бесчисленные вопросы и аргументы. Выражаю особую благодарность Ли и Александре Бенэм, Паскалю Бойеру, Рэндоллу Калверту, Джону Дробаку, Сукоо Ким, Джеку Найту, Гэри Миллеру, Джону Наю, Норману Скофилду и Итаю Сенеду.

В Стэнфорде особую помощь в расширении моих познаний мне оказали Пол Дэвид, Стив Хейбер, Авнер Грайф, Уолтер Пауэлл, Нейт Розенберг и Барри Вейнгаст.

Я также глубоко признателен участникам конференций (помимо вышеупомянутых), посвященных различным темам данной книги, в том числе Ли Элстону, Роберту Кутеру, Леде Космидес, Трауинну Эггертссону, Джин Энсмингер, Грегори Гроссману, Филипу Хоффману, Тимуру Курану, Крису Мантзавиносу, Джоэлю Мокиру и Вернону Смиту.

Я признателен Кевину Маккэйбу, который в сотрудничестве со своими коллегами по экспериментальной лаборатории Университета Джорджа Мэйсона проводил эксперименты, имеющие целью проверить ряд основополагающих предположений данного исследо-

вания. Продолжительные дискуссии с Энди Кларком и Мерлином Дональдом позволили мне лучше разобраться во многих важнейших проблемах когнитивной науки.

Джоэль Мокир и Джон Уоллис прочитали всю рукопись, сделав по ней подробные замечания; Филип Кифер сделал то же самое, работая в Непале. Питер Догерти из издательства Принстонского университета также выступил с подробными замечаниями по всей рукописи. Их комментарии позволили существенно улучшить окончательный вариант.

Моя некомпетентность в обращении с компьютером более чем компенсировалась содействием способных экспертов, неоднократно приходивших мне на выручку, — Боба Паркса и Флорина Петреску в Сент-Луисе и Дэна Вилхелми в Институте Гувера. Кроме того, я признателен за ценную помощь двум помощникам по исследованиям — Арту Кардену и Ури Суходольскому и моему умелому секретарю Фанни Батт.

Глубочайшую благодарность выражаю своей супруге Элизабет Кейс, которая не только взяла на себя редактуру всей рукописи, но и стойко перенесла длительный и порой весьма мучительный период выживания этой книги.

Хочу также поблагодарить за любезное разрешение использовать следующие издания.

Вышедшее в издательстве Стэнфордского университета: *North D. C. The Paradox of the West // Origins of Modern Freedom in the West / R. W. Davis (ed.), copyright 1995 by the Board of Trustees of the Leland Stanford Jr. University.*

Вышедшее в издательстве Йельского университета: *North D. C., Summerhill W., Weingast B. Order, Disorder, and Economic Change // Governing for Prosperity / B. Bueno de Mesquita, H. Root (eds.), copyright 2000 by Yale University.*

# I. КРАТКИЙ НАБРОСОК ПРОЦЕССА ЭКОНОМИЧЕСКИХ ИЗМЕНЕНИЙ

Понимание экономических изменений в широком смысле слова, начиная с восхождения западного мира и заканчивая распадом СССР, требует от нас анализа гораздо более широкого спектра явлений, чем сами эти изменения. Последние являются результатом изменений (1) в количестве и качестве населения; (2) в количестве человеческого знания, и в особенности знания, касающегося нашей власти над природой; и (3) в институциональном каркасе, который задает продуманную стимулирующую систему общества. Всеобъемлющая теория экономических изменений, таким образом, объединяла бы в себе теории демографического развития, накопления знания и институциональных изменений. У нас нет пока хороших теорий для каждой из этих сфер, и мы пока не способны связать их в единую теорию, но все же здесь есть определенный прогресс. Центральная тема этого исследования, которая также является ключевой для улучшения экономических показателей, — это сознательные усилия людей, направленные на установление контроля над миром, в котором они живут. Соответственно, приоритет здесь отдается институциональным изменениям, которые влекут за собой стимулирующие последствия для демографического развития и накопления знания. Однако нет причин считать, что такой подход уместен и для двух последних типов изменений.

Структура, которую мы накладываем на наши жизни для уменьшения неопределенности, состоит из предписаний и запретов, а также артефактов, кото-

рые возникают в процессе их накопления. Результатом является сложная смесь формальных и неформальных ограничений. Эти ограничения встроены в язык, материальные вещи и убеждения. Вместе они определяют формы взаимодействия между людьми. Если мы концентрируемся исключительно на экономике, то имеем дело с дефицитом, а следовательно, с конкуренцией за ресурсы. Структура ограничений, которую мы накладываем для упорядочивания этой конкуренции, определяет правила игры. Поскольку различные виды рынков (политических и экономических) имеют различные границы, в рамках которых может разворачиваться конкуренция, то накладываемая нами структура определяет, будет ли структура конкуренции приводить к увеличению экономической эффективности или к стагнации. Так, хорошо развитые права собственности, которые стимулируют продуктивность, будут увеличивать рыночную эффективность. Динамическая структура политических и экономических рынков является ключом для понимания производительности.

Хотя неопределенность, которая пронизывает наше существование, может быть уменьшена при помощи наложенных нами структур, полностью устранить ее невозможно. Накладываемые нами ограничения сами имеют неясные последствия, что отражает как наше несовершенное понимание окружающей действительности, так и равно несовершенную природу формальных правил и неформальных механизмов, которые мы используем для внедрения этих ограничений.

Эта книга является исследованием неустанных попыток людей получить большую власть над собственной жизнью и того, как эти попытки сталкивались с новыми и неожиданными проблемами, которые следовало разрешать. Это исследование идей (perceptions), которые влекут за собой институциональные инновации, направленные на уменьшение неопределенности или преобразование неопределенности в риск. Это

также исследование постоянно изменяющегося человеческого ландшафта. Данный ландшафт бросает новые вызовы, вследствие чего стратегии, возникающие из «нерациональных» объяснений, зачастую играют свою роль в структурах, которые мы создаем.

1

Базовое описание процесса экономических изменений является простым. «Реальность» политэкономической системы никогда не доступна какому-либо наблюдателю целиком, но люди вырабатывают весьма изощренные убеждения относительно природы этой «реальности». Убеждения, которые одновременно являются позитивной моделью того, как система работает, и нормативной моделью того, как она должна работать. Система таких убеждений может быть широко распространена в обществе, отражая консенсус убеждений. Возможна также ситуация, в которой члены общества придерживаются резко противоположных взглядов, что в свою очередь отражает фундаментальное разделение в отношении идей, касающихся общественного устройства. Доминирующие убеждения, то есть те, которые разделяют политические и экономические предприниматели, способные определять политику, со временем вырастают в структуру институтов, определяющих экономическое и политическое поведение. Складывающаяся в итоге институциональная матрица накладывает серьезные ограничения на возможности выбора для лидеров, которые пытаются модернизировать существующие или создать новые институты для того, чтобы улучшить свои экономические или политические позиции. Возникающий отсюда «эффект колеи» приводит к тому, что изменения обычно становятся пошаговыми, хотя редкие радикальные и неожиданные институциональные изменения наводят на мысль о том, что нечто, напоминающее периодическое нарушение равновесия в эво-

люционной биологии, может иметь место и в экономике. Изменения тем временем продолжают (хотя их интенсивность будет зависеть от уровня конкуренции между организациями и их руководителями), поскольку лидеры пробуют все новые способы улучшить свои конкурентные позиции. Результатом становится изменение институциональной матрицы, а следовательно, пересмотр представлений о реальности, из чего проистекают новые попытки предпринимателей улучшить свои позиции в бесконечном процессе изменений. Ключом к пониманию процесса изменений становится интенциональность игроков, стоящих за процессом институциональных изменений, а также их видение положения вещей. В прошлом, как и в современном мире, экономический рост был эпизодическим явлением, потому что в намерение игроков не входило увеличение общественного благосостояния или же их видение положения вещей было настолько несовершенным, что последствия их действий радикально расходились с намерениями.

Природа этого всеобщего процесса может быть проиллюстрирована на примере краткого анализа взлета и падения Советского Союза (более подробно я буду обсуждать эту тему позднее). Маркс и Энгельс предложили систему убеждений, которая была источником революционного вдохновения для Ленина. Она объясняла не только то, каким мир был, но и то, каким он должен был стать. Обстоятельства, сложившиеся в раздираемой войной России в 1917 году, обеспечили необычную возможность для резкого институционального изменения. Хотя Маркс не оставил рецепта создания социалистического общества или трансформации старого мира, его базовые идеологические модели, в особенности та, что касалась понятия частной собственности, оставались путеводной нитью для советских лидеров (а также ограничением для них). Крайняя необходимость заставила отказать от принципов и привела в 1921 году к началу

новой экономической политики (нэпа). Первый пятилетний план в 1928 году стал возвращением к идеологической ортодоксии. В первые годы советской власти обширная дискуссия об альтернативных стратегиях и, следовательно, институтах помогла создать социализм. Постоянное разрастание сложной институциональной матрицы привело к осязаемым успехам (таким как в тяжелой промышленности) и провалам (таким как в сельском хозяйстве), а также к попыткам исправить неудачи в рамках системы убеждений, характерной для марксистской ортодоксии. Пока экономика росла, пережив опустошительные разрушения в ходе нацистского вторжения, а затем — длительный процесс восстановления, институциональная матрица продолжала видоизменяться под действием внешних стимулов, войны или внутренних представлений о необходимости институциональных коррективов, направляемых системой убеждений, которая возникла в идеологических рамках марксизма. Результатом на протяжении 1950-х, 1960-х и начала 1970-х годов был быстрый рост физических объемов продукции, военных технологий и научного знания: СССР получил статус сверхдержавы.

В эту эпоху почти полмира находилось под властью социалистических или коммунистических режимов, а соответствующие идеологии повсеместно рассматривались как предвестие будущего. Но затем рост начал замедляться, проблемы с сельским хозяйством стали как никогда более острыми, а попытки институциональной реформы с целью устранения проблем — неэффективными. После прихода к власти Горбачева в 1985 году политика следующих шести лет привела к полному упадку и в конечном счете к распаду Советского Союза — пожалуй, наиболее поразительному случаю умышленно вызванного, быстрого распада государства во всей человеческой истории.

Эта история Советского Союза является историей воспринимаемой реальности → убеждений → инсти-

тутов → стратегий → изменения представлений о реальности и т. д. Ключевым в ней является то, каким образом убеждения становились иными под воздействием трансформирующегося восприятия реальности как следствия внедряемой политики, а также адаптивная эффективность институциональной матрицы (насколько она чувствительна к изменениям, когда результаты отличаются от намерений) и ограничение изменений в формальных правилах как корректировка к полученным сбоям.

Одно дело — уметь дать обобщенное описание процесса экономических изменений, и другое — получить достаточно информации, которая наполнила бы это описание и привела бы нас к пониманию самого процесса. Насколько хорошо мы понимаем реальность? Как формируются убеждения? Чьи убеждения имеют значение и как индивидуальные убеждения приводят к формированию систем убеждений? Как изменяются последние? Каковы отношения между убеждениями и институтами? Как изменяются институты? Как институты влияют на экономические показатели? Как можно объяснить различные модели производительности экономики и политики? И, возможно, самый фундаментальный вопрос: в чем состоит существенная природа самого процесса изменений? Оставшаяся часть этой главы посвящена отдельным кусочкам этого пазла.

## 2

Какая фундаментальная сила движет человеческими стремлениями, источником нашей интенциональности, которая идет от способности осознавать себя? Это постоянные попытки людей рассматривать окружающий их мир как интеллигибельный, то есть уменьшать число неопределенностей, существующих в нем. Однако сами эти попытки людей рассматривать мир как познаваемый при помощи разума приводят к продол-

жающим изменениям в нем и, как следствие, к новым вызовам, связанным с его пониманием. Исследование процесса экономических изменений поэтому начинается с исследования настойчивых попыток человеческих существ противостоять неопределенности в неэргодическом мире.

Что мы вообще пытаемся моделировать в наших теориях, убеждениях, идеологиях? Прагматический подход утверждает, что речь идет о том, насколько наши верования соответствуют «реальности». Настолько, насколько им это удастся, у нас есть шансы на то, что наши стратегии будут иметь желаемые результаты. Однако поскольку в течение человеческой истории мы намного чаще ошибались (не понимали реальность), чем создавали правильные теории (понимали ее), то очень важно быть максимально внимательными к природе реальности. Еще более важно внимание к тому, как именно реальность изменяется. Убеждения и то, как они возникают, находятся в центре теоретических проблем данной книги. Большинство экономистов, за редкими, но важными исключениями вроде Фридриха Хайека, игнорировали роль идей в принятии решений. Допущение рациональности отлично служило экономистам (и другим социальным ученым) в решении ограниченного перечня проблем в области микротeorии, но его недостаточно для решения проблемы, центральной для данного исследования<sup>1</sup>. В действительности не критическое принятие допущения рациональности разрушительно для большинства проблем, стоящих перед гуманитарными учеными, и является серьезным препятствием на пути дальнейшего развития науки. Допущение рациональности не является ошибочным, но его принятие с самого начала закрывает возможность более глубокого пони-

<sup>1</sup> Рассмотрение того, при каких условиях допущение рациональности оказывается полезным, а при каких — нет, см.: [Denzau and North, 1994].

мания процесса принятия решения в ситуации противостояния неопределенности сложного мира, созданного нами.

Способ нашего восприятия мира и конструирования наших объяснений этого мира требует того, чтобы мы занялись тщательным анализом работы сознания и мозга, предмета, которым занимается когнитивная наука. Эта область исследований все еще весьма молода, но уже сегодня она имеет достаточно важные результаты, полезные для изучения социальных явлений. Это вопросы, касающиеся того, как люди реагируют на неопределенность, и в особенности на неопределенность, возникающую из изменяющегося человеческого ландшафта, природы человеческого обучения, отношений между ним и системами убеждений, а также последствий особенностей сознания и человеческой интенциональности для структуры, которую люди накладывают на окружающую их действительность.

Люди пытаются использовать свои представления о мире для структурирования окружающей действительности таким образом, чтобы снизить неопределенность в отношениях с другими людьми. Но ответ на вопрос, чьи именно представления имеют значение и как они могут быть переведены в трансформацию окружающей человека действительности, зависит от институциональной структуры, которая является комбинацией формальных правил, неформальных ограничений и особенностей их выполнения. Структура отношений между людьми определяет, кто является теми лидерами, выборы которых имеют значение, а также то, как данные выборы реализуются при помощи решений, управляющих данной структурой. Институциональные ограничения накапливаются с течением времени, так что культура общества есть кумулятивная структура правил и норм (а также убеждений), которую мы наследуем из прошлого, которая определяет наше настоящее и влияет на наше будущее. Институты изменяются, как правило, постепенно, поскольку политические

и экономические лидеры получают новые возможности или реагируют на новые опасности, угрожающие их благополучию. Институциональные изменения могут стать результатом изменений в формальных правилах, неформальных нормах или же их выполнении. Политико-экономическая структура общества и способ его возникновения играют решающую роль в определении того, чей выбор имеет значение и как он в конечном счете формирует политику.

Мы можем начать складывать отдельные кусочки вместе для того, чтобы изучать (очень поверхностно) процесс экономических изменений. Похож ли этот процесс на модели, выводимые из эволюционной биологии? Какое значение имеет интенциональность игроков и какова природа человеческой интенциональности, которая является непосредственным источником институциональных изменений? Является ли неопределенность, с которой сталкиваются люди, следствием неотъемлемой нестабильности человеческого ландшафта или же она происходит из наших систем восприятия реальности и убеждений? Каковы базовые источники «эффекта колеи» и как именно он влияет на экономические показатели? И наконец, что создает адаптивную эффективность — способность некоторых обществ справляться с потрясениями, гибко приспосабливаясь к ним, и формировать институты, которые эффективно работают с измененной «реальностью»?

Во второй части этой книги я применяю аналитический каркас, разработанный в первой части, для того чтобы попытаться представить более глубокое понимание процесса изменений, как имевшего место в истории, так и современного. Я обобщенно намечаю изменения в человеческом ландшафте в течение тысячелетий, прошедших с тех пор, как люди возникли как отдельный биологический вид, концентрируясь при этом на последних двух тысячелетиях. Акцент здесь делается на резком различии между институтами, соз-

данными для противостояния неопределенности, являющейся следствием нашей естественной окружающей среды, и институтами, которые создавались для работы с нашим социальным окружением. Трудности, возникающие при изменении институционального каркаса от такого, который был создан для противостояния физическому окружению, к тому, который способен иметь дело с современной средой, окружающей человека, лежат в центре многих фундаментальных вопросов экономического развития.

В западном мире, и в частности в США, мы склонны рассматривать порядок как некое естественное состояние. Мы не должны этого делать. Беспорядок — революции, отсутствие личной безопасности, хаос — характеризует существенную часть человеческого состояния, свидетелем чему может выступать бурная история Латинской Америки. Порядок предполагает снижение неопределенности, которое неизбежно характеризует человеческое состояние в результате функционирования институтов, обеспечивающих большую предсказуемость в отношениях между людьми. Беспорядок увеличивает неопределенность, поскольку права и привилегии индивидов и организаций достаются «кому попало» (*up for grabs*) вследствие нестабильных отношений как на политических, так и на экономических рынках. Понимание основополагающих условий порядка и беспорядка важно для понимания процесса экономических изменений.

Насколько успешно мы контролируем собственную судьбу? В духе Герберта Саймона, который обратил наше внимание на эти проблемы, зададимся вопросом: какое значение имеет тот факт, что люди неспособны достичь такого типа рационального поведения, которое включало бы в себя полное знание обо всех возможных обстоятельствах, исчерпывающее знание о дереве решений, а также точных взаимосвязей между действиями, событиями и последствиями? Краткий ответ состоит в том, что это имеет большое значение.

Экономическая история — это грустная сказка о прочетах, приводивших к голоду, недоеданию, поражениям в войнах, смерти, застою и упадку экономики, а в конечном счете и к исчезновению целых цивилизаций. И даже самое поверхностное изучение сегодняшних новостей показывает, что эта сказка не является достоянием прошлого. Сегодня мы иногда делаем правильные вещи, свидетельством чему является впечатляющий экономический рост последних нескольких столетий. Но нынешний успех вряд ли является окончательной точкой развития.

Убеждения и соответствующие институты, которые обусловили расцвет западного мира, иллюстрируют смесь пронизательных суждений и удачи, которые сошлись, чтобы сделать более или менее правильный выбор. Более важная цель состоит в том, чтобы рассказать историю в ее динамике — рассмотреть процесс успешных изменений во времени. Расцвет и упадок Советского Союза являются отрезвляющим примером того, как может работать человеческое стремление к созданию преднамеренно сконструированного общества. Я рассмотрю этот предмет более глубоко для того, чтобы проанализировать два аспекта экономических изменений: (1) неотъемлемые трудности, связанные с преднамеренными попытками изменения социального каркаса при весьма несовершенном знании игроков, и (2) процесс распада общества, которое борется с жесткими и ошибочными убеждениями, противостоящими попыткам начать фундаментальные изменения.

Приращение опыта, полученного в ходе попыток улучшить экономические показатели третьего мира и стран переходной экономики, и то, чему мы научились из историй успеха, наделяют нас некоей базовой лабораторией, а также отрезвляющим пониманием того, как мало мы знаем об этом процессе. Но мы учимся, и я покажу, что мы уже знаем сегодня, а что нам еще нужно понять для лучшего понимания процесса.

Очевидным следствием понимания процесса изменений является ограничение, которое накладывает на способность человека предсказывать будущее. В этой книге я рассмотрю вопрос о том, что мы действительно можем знать о будущем, а что должно остаться уделом астрологов, прорицателей и политиков. Основная идея этого исследования состоит в том, чтобы предложить отрезвляющую оценку будущего человечества перед лицом повсеместной неопределенности неэргодического мира.

# Часть первая

*Проблемы, связанные с пониманием  
процесса экономических  
изменений*

## ВВЕДЕНИЕ

Какой теоретический каркас нам нужно разработать для понимания процесса экономических изменений? Теория, которой мы располагаем, является статичной. И хотя по-настоящему динамическая теория может оказаться недоступной для нас, мы можем ввести в наш анализ временное измерение в качестве одного из параметров. Нам необходимо разработать корпус обобщений относительно того, как различные экономики функционируют во времени. Наша цель должна состоять в том, чтобы сконцентрироваться на тех элементах общества, которые лежат в основе этого процесса и которые формируют его. Экономика является теорией выбора: с этим положением никто не спорит. Однако эта дисциплина отказывается от изучения того контекста, в котором делается выбор. Мы выбираем из альтернатив, которые сами по себе являются конструкциями, созданными человеческим сознанием. Поэтому то, как работает сознание и как оно понимает окружающую среду, является фундаментом настоящего исследования. Но что подразумевается под средой? Среда, которая окружает человека, — это набор правил, норм, конвенций и способов поведения, созданных человеком и определяющих структуру отношений между людьми. Эта среда разделяется специалистами по социальной науке на различные сегменты, изучаемые такими науками, как эконо-

мика, политология, социология. Но конструкции человеческого сознания, в которых мы нуждаемся для того, чтобы осмыслять окружающую среду, не совпадают с этими искусственными категориями. Наш аналитический каркас должен интегрировать результаты этих искусственно разделенных дисциплин, если мы хотим понимать процесс изменений. Более того, мы должны понимать, какая глубинная сила управляет конструкциями, которые порождает сознание. Почему существуют правила, нормы, конвенции и способы поведения? Что заставляет сознание структурировать человеческие отношения таким образом? Новая институциональная экономика (НИЭ) находится на полпути к отысканию ответов на эти вопросы. Она сосредотачивается на убеждениях, которые создаются людьми для объяснения окружающей среды, и институтах (политических, экономических и социальных), которые создаются для того, чтобы формировать эту среду. Первая часть этой книги посвящена изучению того, что заставляет людей создавать эти искусственные конструкции, а также разработке и расширению числа инструментов НИЭ, способных обеспечить каркас для детального исследования природы экономических изменений.

## II. НЕОПРЕДЕЛЕННОСТЬ В НЕЭРГОДИЧЕСКОМ МИРЕ

Интеллектуальное путешествие, в которое мы отправляемся, требует от нас переосмысления оснований традиционной экономической теории, и в особенности тех оснований, которые касаются двух вопросов, исследуемых в данной главе, — неопределенности и эргодичности. Как правило, экономисты не задумываются о структуре, которая накладывается на

ми на их сознание для упорядочивания окружающей среды и тем самым для уменьшения неопределенности. Экономисты также не считаются с динамической природой мира, в которой мы живем и которая продолжает ставить перед нами все новые проблемы, нуждающиеся в решении. Последний пункт поднимает фундаментальный вопрос. Если мы постоянно заняты созданием нового, небывалого прежде мира, то насколько хороша для его описания окажется наша старая теория, сделанная нами на основе накопленного опыта? Эти вопросы являются центральными для данного исследования. Мы должны самым тщательным образом исследовать глубинные источники тех сил, которые заставляют людей создавать присущие им структуры. Недостаточно описать социальные изменения. Вместо этого мы должны попытаться найти фундаментальные силы, определяющие процесс изменений.

1

Неопределенность имеет богатую историю в экономической литературе. Обычно ее ведут от различия между риском и неопределенностью, предложенного Фрэнком Найтом в классическом исследовании, опубликованном в 1921 году. Для Найта риск являлся состоянием, в котором имеется возможность получить распределение вероятностей исходов таким образом, чтобы застраховать их. Неопределенность, согласно Найту, была состоянием, в котором такого распределения вероятностей не существует. Поэтому, как писали видные теоретики, такие как Кеннет Эрроу [Arrow, 1951] и Роберт Лукас [Lucas, 1981], строить теории в условиях неопределенности было невозможно. Позднее значение терминов несколько изменилось, причем под неопределенностью стало пониматься то, что Найт описывал как риск, а термин «неоднозначность» (ambiguity) стал указывать на то, что Найт по-

нимал под неопределенностью<sup>1</sup>. Я буду использовать термины в первоначальном значении, предложенном Найтом, хотя и с некоторыми уточнениями, сформулированными в последующих параграфах.

Сами экономисты при обсуждении этой темы выражались весьма неоднозначно, что главным образом проистекало из представления о неопределенности как об отклонении. Поэтому нормальное состояние, то есть определенность, давало право на элегантное математическое моделирование, ставшее признаком формальной экономической теории. Однако неопределенность не является отклонением от нормы, это фундаментальное условие, ответственное за развитие структуры социальной организации в ходе истории и в доисторические времена. Для того чтобы корректно обсуждать этот вопрос, мы должны определить данный термин несколько иначе по сравнению с тем, как это делал Найт. Найт сводил свою дефиницию к вероятностному критерию. Более общий подход связан с указанием на то, что люди имеют неустранимое стремление делать окружающую среду более предсказуемой. Это стремление может охватывать все что угодно, начиная от подсчета исходов для поиска статистической вероятности и заканчивая попытками уменьшения настолько фундаментальных неопределенностей, что у нас просто нет ключа к пониманию возможных исходов. В последнем случае речь, например, может идти о значении ядерной энергии для будущего человечества. Рональд Хайнер в своей статье, имеющей огромную важность для экономического анализа, схватывает самую суть вопроса, утверждая, что неопределенность была «источником предсказуемого поведения» [Heiner, 1983]. Статья Хайнера указывает в качестве источника институциональной инновации на то, что он называет К-Р-разры-

<sup>1</sup> На этот счет существует весьма обширная литература. Хороший обзор проблемы и библиографию можно найти у Мански [Manski, 1996] и Дэвидсона [Davidson, 1991].

вом, то есть разрывом между компетентностью агента и сложностью задачи принятия решения. Сталкиваясь с таким разрывом, агент будет определять правила для того, чтобы ограничить число вариантов выбора в подобных ситуациях. Эти правила известны нам как институты. При помощи сведения числа выборов к более ограниченному набору действий институты могут улучшить способность агента контролировать свою среду (хотя отсюда не следует вывод о том, что понимание ситуации агентом является корректным). Хайнер указывает нам путь к аналитическому каркасу, разработанному в оставшейся части этого исследования. Создание институционального каркаса стало существенным элементом цивилизации.

Убеждения и институты, создаваемые людьми, имеют смысл лишь в качестве непрерывной реакции на различные уровни неопределенности, с которыми мы сталкиваемся в рамках динамически развивающегося физического и социального ландшафта. Несмотря на то что фундаментальная причина создания институтов связана с попыткой людей структурировать окружающую среду для того, чтобы сделать ее более предсказуемой, соответствующие попытки могут и зачастую действительно приводят к увеличению неопределенности для некоторых игроков. Развитие формального права собственности, к примеру, делает общий уровень окружающей социальной среды более предсказуемым, однако увеличит неопределенность для тех, кто традиционно использовал ничейную землю, не обладая конкретными правами на нее. Существенный вопрос, который мы должны задать, заключается поэтому в том, кто именно создает правила, для кого они создаются и какие цели при этом преследуются<sup>2</sup>. Институты

<sup>2</sup> Важно также отличать неопределенность для индивида от неопределенности для общественных групп. Хотя решения принимаются индивидами, именно изменение неопределенности для групп находится в центре нашего интереса. Впрочем, такое различие затемняет сложное

и эффективность в том смысле, как этот последний термин употребляется экономистами (зачастую ошибочно), не являются тождественными понятиями<sup>3</sup>. Одна из главных загадок, которую нужно разрешить, в действительности состоит в том, как и при каких условиях люди создают условия, делающие возможным существование рынков с низкой стоимостью транзакций и растущим материальным благосостоянием.

Мы можем начать отвечать на вопрос относительно правил с обсуждения способа, при помощи которого люди пытались делать окружающую среду более предсказуемой. Все начинают жить, сталкиваясь с неустранимой неопределенностью. Начальная неопределенность уменьшается при помощи получения опыта двух видов. Во-первых, речь идет об опыте, связанном с познанием физической среды, а во-вторых, об опыте, связанном с погружением в социокультурную языковую среду. Опыт отличается в разных культурах как синхронически, так и диахронически. Люди будут иметь различные интерпретации окружающей среды и, соответственно, сталкиваться с неопределенностью. Поэтому знание о том, как в сознании происходит процесс обучения, является существенным для понимания способов, при помощи которых люди справляются с неопределенностью.

взаимодействие между индивидуальным риском и неопределенностью и риском и неопределенностью, стоящим перед сообществом. Это взаимодействие будет исследоваться нами в следующих главах.

<sup>3</sup> В данной работе под эффективностью я понимаю такое состояние, при котором при заданных состоянии технологий и издержках на информацию рынок имеет наименьшие возможные себестоимость производства и транзакционные издержки. Термин почти всегда используется в относительном, а не абсолютном значении. Более того, хотя экономическая эффективность совпадает с улучшением материального благосостояния, на политических рынках последствия благоденствия являются более неопределенными, как будет показано в главе V.

В ходе человеческой истории мы всегда имели некоторый довольно существенный остаток, не поддающийся рациональному объяснению: остаток, который частично анализировался людьми в иррациональных терминах, предлагаемых колдовством, магией и религиями. Кроме того, этот остаток также был до некоторой степени обусловлен более прозаическим иррациональным поведением, определяемым догмами, предрассудками и «сырыми» теориями<sup>4</sup>. И на самом деле, несмотря на упомянутое выше утверждение видных теоретиков о том, что невозможно строить теории о неопределенности, люди постоянно занимаются именно этим. Их усилия варьируются от суждений, сделанных задним числом, и плохо структурированных убеждений вроде тех, что подразумеваются под ярлыками «консервативный» и «либеральный», до утонченных систематических идеологий, таких как марксизм или институциональные религии.

Общая характеристика человеческой истории состоит в систематическом снижении уровня воспринимаемой неопределенности, связанной с физической средой и, следовательно, с сокращением тех источников неопределенности, которые должны объясняться при помощи убеждений, включенных в колдовство, магию и религии. Но если неопределенность, связанная с физической средой, уменьшалась, следствием этого становилась намного более сложная социальная среда. И хотя нам удалось добиться определенного прогресса в понимании этой социальной среды, наше понимание очень ограничено и включает в себя множество иррациональных объяснений. Одна из причин ограниченности нашего понимания заключается в том, что в социальных науках, по-видимому, не существует фундаментальных «степенных законов», сопоста-

<sup>4</sup> Под рациональным я понимаю объяснение, которое логически непротиворечиво и по крайней мере гипотетически может быть предметом эмпирической проверки.

вимых с аналогичными, имеющимися в естественных науках. Более фундаментальная причина связана с неэргодической природой мира, который постоянно изменяется нами. Эргодическая экономика — это экономика, в которой фундаментальная структура является постоянной, неизменной во времени. Однако мир, в котором мы живем, является неэргодическим — это мир постоянно возникающих новых изменений. Осмысление мира, находящегося в процессе становления, ведет к появлению новой теории или по крайней мере к изменению той, которой мы располагаем. В результате такого положения вещей мы не можем делать вывод о том, что у нас «все схвачено», несмотря на впечатляющие достижения в науке, которые в значительной мере снизили неопределенность относительно физической среды. Помня об этом, давайте посмотрим, как люди с течением времени изменяли окружающую среду для того, чтобы сделать ее более предсказуемой. Вернемся к дефиниции неопределенности и выделим в этом понятии несколько уровней:

1. Неопределенность, которая может быть уменьшена при увеличении количества информации в рамках существующего объема знаний (stock of knowledge)<sup>5</sup>.
2. Неопределенность, которая может быть уменьшена при увеличении объема знания в рамках существующего институционального каркаса.
3. Неопределенность, которая может быть уменьшена только при помощи изменения институционального каркаса.

<sup>5</sup> Я определяю знание как накопление регулярностей и закономерностей в физической и социальной среде, которое приводит к созданию структурированных объяснений тех или иных аспектов этих сред. Это не означает, что такое знание является истинным.

4. Неопределенность, характерная для новых, не встречавшихся прежде ситуаций, которая влечет за собой изменение структуры убеждений.
5. Остаточная неопределенность, которая выступает основой для «иррациональных» убеждений.

Написание книги, которая изучала бы все эти исторические процессы, стало бы серьезным вызовом для историков экономики. Вот краткий разбор каждой из этих категорий:

1. Получение большей информации относительно особенностей человеческой деятельности приводит к предсказуемости. Например, развитие страхования мореплавания в XV веке, которое привело к сбору и анализу информации о кораблях, грузах, маршрутах, времени пути, кораблекрушениях, повреждениях, позволило превратить неопределенность в риск. Это стало важным фактором в росте торговли в Европе эпохи раннего Нового времени.
2. Увеличение объема знаний является фундаментальным источником роста человеческого благосостояния<sup>6</sup>. Определенная часть этого увеличения происходила без изменений в институциональной структуре, выступая источником изменения стимулов. Увеличение объема знания в рамках существующего институционального каркаса в ходе истории имело место как следствие неустранимой тяги людей к изобретениям и инновациям — даже в отсутствие институциональных стимулов, что можно заметить, анализируя историю творческой деятельности человека. Другие важные источники увеличения объема знания заключались в изменении отно-

<sup>6</sup> Глубокий анализ знания, полезного знания и его отношения к экономической производительности см.: [Mokyr, 2002].

сительных цен или формировании новых убеждений, которые в равной степени вели к перераспределению ресурсов. Фундаментальные изменения в относительных ценах на факторы производства в ходе истории преобразовывали стимулы к получению знаний об этих средствах производства. К примеру, неолитическая революция и эпидемия чумы в Европе XIV века привели как к фундаментальным социальным изменениям, так и к перераспределению ресурсов и приобретению знаний (см.: [North, 1981, chs. 7, 10]). Что касается изменений в убеждениях, то в конечном счете именно идеи и их результаты находятся в центре внимания данного исследования. Ведь это они — иногда к благу, а иногда и к несчастью — являются фундаментальной движущей силой человеческого состояния.

3. Изменение институционального каркаса влечет за собой изменение в структуре стимулов и является существенным условием для уменьшения неопределенностей окружающей среды с течением времени. Оно выступает важным инструментом, при помощи которого люди пытались осознанно изменять свою среду существования. Оно направляет многочисленные современные попытки повышения производительности стран третьего мира. В исторической перспективе институциональные изменения приводили к увеличению выгоды от совместной деятельности (например, законное принуждение к исполнению контрактов), усилению стимулов к изобретению и инновациям (патентное законодательство), увеличению выгоды от инвестиций в человеческий капитал (развитие институтов, интегрирующих разрозненное знание сложных экономик) и снижению стоимости трансакций на рынках (создание юридической системы, которая понижает стоимость принуждения к исполнению контрактов).

4. Ответ людей на новые ситуации зависит от того, насколько они неожиданны, а также от культурного наследия агентов. Культурное наследие во многих случаях будет определять их успех или неудачу. В той мере, в которой культурное наследие позволяет им решать подобные проблемы, они могут фактически выдавать ответы, которые делают окружающую среду более предсказуемой. Если соответствующее наследие отсутствует, они могут отвечать неподходящим образом или передавать проблему на суд магии и/или аналогичным иррациональным методикам. Это можно проиллюстрировать на примере характерного ответа экономик на сдвиг от персонального к имперсональному обмену. Экономисты, развившие культурное наследие, которое привело их к формированию институтов обезличенного обмена, успешно справились с этим фундаментальным новшеством. Те, у кого подобного наследия не было, не смогли выполнить эту задачу, описание чего можно найти у Авнера Грейфа [Greif, 2006].
5. Несмотря на тот факт, что неопределенность, связанная с физической окружающей средой, была радикально уменьшена (хотя это и привело к увеличению неопределенности в отношении социальной среды), остаток, который ведет к иррациональным убеждениям, играет в современном мире не менее важную роль, чем прежде. История религий и их широкая популярность сегодня могут служить тому примером. Системы религиозных убеждений, такие как исламский фундаментализм, играли и продолжают играть важную роль в определении социальных изменений. Но в той же мере для принятия решений важна критическая роль секулярных идеологий и систем убеждений, что так ярко иллюстрируется примером расцвета и упадка Советского Союза.

Термин «эргодический» определяется в словаре Уэбстера как «относящийся к вероятности того, что некоторое состояние будет повторяться, в особенности с нулевой вероятностью того, что некоторое состояние не повторится никогда». Соответственно, «эргодический стохастический процесс означает лишь то, что средние величины, вычисленные на основе прошлых наблюдений, не могут существенно отличаться от средних будущих результатов» [Davidson, 1991, 132]. Для Сэмюэльсона эргодическая гипотеза была существенной для научной экономики [Samuelson, 1969, 184]. И действительно, эргодическая гипотеза имплицитно принимается во многих нынешних экономических теориях. Роберт Солоу, обсуждая фундаментальные допущения экономической теории, описывал эту точку зрения так: «У меня складывается ощущение, что лучшее и наиболее яркое в нашей профессии работает так, как если бы экономика была бы физикой общества. Существует лишь одна общезначимая модель мира. Все, что нужно сделать, это применить ее» [Solow, 1985, 330].

Однако для историка экономики, изучающего десять тысячелетий человеческой истории, начиная с неолитической революции, эргодическая гипотеза является а-исторической. Более того, экстраординарные изменения всех аспектов современного общества говорят сами за себя. Они свидетельствуют о том, что мы создавали и создаем общества, являющиеся уникальными по сравнению со всем, что имело место в прошлом.

Естественные науки используют редукцию для того, чтобы прийти к фундаментальным принципам, которые (вероятно) делают эти науки эргодическими. Социальные науки не имеют таких фундаментальных принципов, за исключением, возможно, бихевиоральной предпосылки, и даже эта последняя вряд ли является удовлетворительной, как показывают ис-

следования в когнитивной науке. Но прямо противоположная позиция, которая сводится к тому, что теория, выведенная на основе прошлого опыта, не имеет значения для понимания настоящего и будущего, также неудовлетворительна. Микроэкономическая теория неоднократно демонстрировала свою объяснительную (и предсказательную) силу в отношении различных сторон экономической производительности. В чем нам следует разобраться, так это с видами теорий и их уместностью в конкретных контекстах неэргодического мира. Однако сначала следует убедиться в том, что мы понимаем, в чем состоят существенные характеристики неэргодического мира.

В самом деле, что это за вещь, которая все время изменяется? Идет ли речь о физическом мире? Да, он изменяется, но мы говорим о социальной среде. И мы сделали важные шаги к тому, чтобы эта среда могла рассматриваться как более предсказуемая. Можем ли мы на этом основании предсказывать, на что она будет похожа завтра? Ответ заключается в том, что временной горизонт для подобного предсказания, строго говоря, будет весьма коротким. Изменения в среде, которые мы делаем сегодня, создают новую и во многих случаях неожиданную среду завтра. Неожиданную в том смысле, что у нас нет исторического опыта, который подготовил бы нас к встрече с ней. Вернемся к анализу, проведенному в предыдущем параграфе:

1. Наступление эпохи морского страхования было важным шагом в расширении международной торговли и интеграции мировых экономик, но оно повлекло за собой нисходящую цепь последствий, которые определенно привели бы в ужас купца XV века.
2. В ходе истории результатами развития военных технологий становились социальные изменения, которые не были и не могли быть предсказаны. На микроуровне речь идет об идее Шумпетера

о том, что созидательное разрушение является существенным свойством инноваций, что приводит к непредвиденным изменениям не только в конкретном продукте, который изменялся целенаправленно, но и к более широким последствиям для социальной реальности. В качестве примера можно привести роль автомобильного транспорта в прошлом веке. Неолитическая революция и эпидемия XIV века запустили процесс фундаментальных изменений в обществе, причем эти изменения имели поистине грандиозные масштабы. Что касается изменяющихся убеждений, то они являются фундаментальной силой, толкающей к изменениям: иногда к ожидаемым, но чаще всего нет.

3. Изменения в институтах, которые ведут к сокращению неопределенности физической среды, создают сложную социальную среду, которая становится источником совершенно нового (и во многих случаях все еще неразрешенного) набора неопределенностей. Технологическая революция последних нескольких веков сделала возможным уровень благосостояния человека, несопоставимый с тем, чего люди могли добиться в прошлом. Однако она также создала мир взаимозависимостей и универсальных экстерналий, а в результате — совершенно новый набор неопределенностей. Торговое право, патентное законодательство, институциональная интеграция разрозненного знания, создание юридической системы являются важной частью усилий, направленных на то, чтобы рынки развивающихся стран стали более эффективными. И они же ведут нас к неизвестному миру будущих неопределенностей. Когда подобные институциональные изменения применяются к экономикам третьего мира, они зачастую изменяют распределение доходов и ведут к политической

нестабильности, что иногда становится причиной цепи явлений, которые прямо противоположны первоначальным целям.

- 4–5. Но как люди справляются с подлинно новыми явлениями? Если природа неэргодического состояния такова, что исторический опыт игроков наделяет их способностью решать проблему (неопределенность первых трех типов), то они могут эффективно справляться с ней. Но в случае подлинно нового явления мы сталкиваемся с неопределенностью, последствия которой нам просто неизвестны. И в этом случае вероятность успешного снижения неопределенности зависит лишь от удачи, а игроки будут действовать исходя из иррациональных убеждений. И действительно, иррациональные убеждения играют большую роль в социальных изменениях.

Последний пункт говорит нам о том, что данный эффект колеи — способ, при помощи которого институты и убеждения, сформированные в прошлом, влияют на нынешние решения, — играет ключевую роль в этой гибкости. Общества, предыдущий опыт которых научил их смотреть на инновационные изменения с недоверием и антипатией, разительно отличаются от тех, чье наследие обеспечило благоприятную среду для таких изменений. В основе этого множества различных форм культурного наследия в каждом случае лежат общие психологические модели участников.

Будущее станет отражать наше понимание нас самих (как рациональное, так и иррациональное), которое продолжает изменяться по мере того, как мы преобразуем нашу социальную (и физическую) среду. Для того чтобы знать будущее, нам потребовалось бы знать сегодня то, что мы будем знать завтра. Чтобы добиться лучшего понимания направления нашего нынешнего движения, нам необходимо сосредоточиться на том, как работает сознание и как оно

осмысляет нашу внешнюю среду. Идеи и более структурированные убеждения, которых мы, люди, придерживаемся, определяют те решения, которые мы принимаем. Последние, в свою очередь, продолжают изменять нашу среду. Когда мы объединяем те вопросы, которые возникают исходя из несовершенства понимания, с вопросами, которые ставятся перед нами неэргодичностью, мы приходим к следующей комбинации, находящейся в центре данного исследования<sup>7</sup>:

1. Совершенное понимание:
  - а. Статическая неопределенность. В каждый момент времени существуют состояния мира, в которых распределение вероятностей не может быть определено. В статичном мире неопределенность зависит от объема знания. Если бы индивиды обладали совершенным пониманием, то не было бы никакой нужды в институтах даже в условиях неопределенности. Если бы такой статичный мир повторялся во времени, то вполне можно предположить, что состояния неопределенности стремились бы к нулю.
  - б. Неопределенность в эргодическом мире. Единственное различие со статическим миром может состоять в том, что состояния неопределенности генерируются случайным образом. Соответственно, с течением времени всегда может оставаться некоторый остаточный уровень неопределенности.
  - в. Неопределенность в неэргодическом мире. Систематические отношения могут меняться с течением времени непредсказуемым образом. Следовательно, могут возникать новые, фундаментально отличные типы неопределенностей. Даже если агенты обладают совершенным пониманием в один момент времени заданной истории

<sup>7</sup> Я благодарен своему коллеге Сукоо Ким за уточнение этих различий.

мира, их действия могут оказаться ошибочными в другой момент. Соответственно, постоянно возникают новые уровни неопределенности. В каком-то смысле с течением времени ценность знания теряется.

2. Несовершенное понимание:

- а–б. Статичная неопределенность и неопределенность в эргодическом мире. Если понимание агента среды является несовершенным, то это делает возможность сохранения неопределенности даже в том случае, если ситуация статической неопределенности повторяется во времени. Результат в значительной мере зависит от того, имеют ли агенты правило оптимального обучения. Несовершенное понимание агента может быть определено как обладание ошибочным распределением вероятностей в состояниях, связанных с рисками, или же как приписывание вероятностей состояниям неопределенности. Иррациональные убеждения, по-видимому, относятся ко второму роду, то есть они приписывают некоторую вероятность состояниям неопределенности, которым невозможно «корректно» приписывать подобную вероятность. В мире неточного понимания неопределенность зависит от знания и институтов.
- в. Неопределенность в неэргодическом мире. Основное отличие здесь заключается в том, что институты, принятые в определенный момент времени, даже если они являются оптимальными (то есть связанными с верным пониманием) в этот момент времени, могут оказаться несовершенными, поскольку социальная среда изменяется с течением времени.

То, как люди справляются с подобными неожиданными событиями, является важной темой для этого исследования.

*Научное издание*  
Серия «Экономическая теория»

ДУГЛАС НОРТ

ПОНИМАНИЕ ПРОЦЕССА  
ЭКОНОМИЧЕСКИХ  
ИЗМЕНЕНИЙ

*Главный редактор*  
ВАЛЕРИЙ АНАШВИЛИ

*Заведующая книжной редакцией*  
ЕЛЕНА БЕРЕЖНОВА

*Редактор*  
ЛИДИЯ ТРОФИМОВА

*Художник*  
ВАЛЕРИЙ КОРШУНОВ

*Верстка*  
СЕРГЕЙ ЗИНОВЬЕВ

*Корректор*  
ЛЮБОВЬ АГАДУЛИНА

ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ  
ВЫСШАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ  
125319, Москва, Кочновский проезд, д. 3  
Тел./факс: (495) 772-95-71

Подписано в печать 02.12.2009. Формат 84×108/32  
Гарнитура Minion Pro. Усл. печ. л. 14,8. Уч.-изд. л. 13,1  
Печать офсетная. Тираж 1000 экз.  
Изд. № 1206. Заказ №

Отпечатано в ГУП ППП «Типография „Наука“»  
121099, Москва, Шубинский пер., 6