



Title	サヴェジ基礎論及び用心
Author(s)	園, 信太郎
Citation	経済学研究, 70(2), 1-2
Issue Date	2020-12-17
Doc URL	http://hdl.handle.net/2115/80154
Type	bulletin (article)
File Information	10_ES_70(2)_001.pdf



[Instructions for use](#)

サヴェジ基礎論及び用心

園 信太郎

1. はじめに

サヴェジ氏の「基礎論」には二つのギャップ (gap) が関わる。一つは、サヴェジ氏が観察している現象と「基礎論」の内容とのギャップ。もう一つは、サヴェジ氏が実際にやっていることと、「基礎論」の文章とのギャップである。これらのギャップに用心しないと、「基礎論」は難解な書物となってしまう。

2. 第一のギャップ

サヴェジ氏が観察しているのは本来の選好である。個人は自身の選好を活用して多様な選択を行っている。しかもしばしばほとんど意識せずに「ふたしか」を「処理」している。例えば、「このリンゴ」に虫食いがある「確率」を、通常は「計算」したりはしない。驚くべきことだが、我我は多様な潜在的「ふたしか」を、ほとんど意識せずに、「計算なし」で切り抜けている。

一方「基礎論」では、A. Wald の枠組みが「たてまえ」として尊重されている。だが、第5章第5節 (Small worlds) まで読み進むと、この「たてまえ」はサヴェジ氏が本当になした事柄を、うまく反映していないことがわかる。彼が問題にしているのは、「大きな世界」、つまり grand world なのである。本来の選好は、この「大きな世界」に関するものであり、A. Wald 的な「小さな世界」に限定されるものではない。つまり、彼がやりたいことは、A. Wald の枠組みではうまく表現できないのである。

3. 第二のギャップ

第1章を読む限りでは、サヴェジ氏は「確率の解釈」を問題にしているように思われる。実際、彼はそのような発言をしている。ところが、第4章 (Critical comments on personal probability) を熟読すると、彼が苦しんでいるのは「確率の定義」であることがわかる。「定義」は当然「確率の計算方法」に強く影響する。しかし、あくまでも「経済行動」に関わる「確率」である。今日でも、彼の (不確定性下選好に基づく) 個人的確率は、経済行動に関する限り最も優れた「確率」であるだろう。つまり、かれの「定義」は健全である。

4. 期待効用

von Neumann と Morgenstern とによるあまりにも有名な「ゲームの理論」の第二版の付録で、von Neumann - Morgenstern 効用が導入された。しかし、それには根本的な問題があった。つまり、「確率」が無定義なのである。合理的な経済行動を考える場合、「無定義な確率に基づく個人的期待効用」を持ち出すのはおかしい。個人が合理的ならば、当然、自身の立場から「確率」を定義するであろう。つまり「個」は、「確率の定義」の問題から逃れられないはずである。

「個」は、(潜在的な) 自身の期待効用に基づいて、個人的期待効用の最大化を行うのである。この期待効用は (潜在的な) 個人的確率に基づく。これが本来のサヴェジ氏の世界である。

5. 補遺—朱子—

「合理」と言えば朱子（朱熹）である。だが、この「理」の字は重い。筆者は、三浦國雄博士の訳注である、『朱子語類』抄』講談社学術文庫、2008年、を一通り読んだのだが、歯がたたず、青息吐息であった。朱子の「理」と数学原理とを対決させることは、筆者には任が重すぎるのだ。しかし、行為の合理性を真剣に問うのならば、朱子は無視できない。朱子は自身の立場から禅仏教を消化し尽くした後に、「理」を措定している。実に重い一字である。

2020年7月1日（水）

参考文献

Savage, Leonard Jimmie, *The Foundations of Statistics, Second Revised Edition*, Dover, New York, 1972. 第一版はWileyより1954年に出ている。サヴェジ氏の「基礎論」である。学生の小生にこの書物の存在を指摘して下さった鈴木雪夫先生（故人）にささやかな謝意を記す。

Savage, Leonard Jimmie, *The Writings of Leonard Jimmie Savage—A Memorial Selection—*, The American Statistical Association, Washington, D. C., 1981. 必読の論文集。

園信太郎, 『確率概念の近傍』, 内田老鶴圃, 東京, 2014年。ぜひとも付録を一瞥して頂きたい。

園信太郎, 『サヴェジ・システム試論』, 内田老鶴圃, 東京, 2017年。St. Petersburg paradox がいかにして消去されるかを御覧頂きたい。