



Munich Personal RePEc Archive

The probability in Keynes: background and influences

Schilirò, Daniele

Università di Messina

February 2000

Online at <https://mpra.ub.uni-muenchen.de/44200/>

MPRA Paper No. 44200, posted 05 Feb 2013 07:37 UTC

Daniele Schilirò*

La probabilità in Keynes: premesse e influenze

Febbraio 2000

Abstract: The probability in Keynes: background and influences

This paper addresses the issue of probability in Keynes. The choice of theme comes from the recent publication of the book edited by Silva Marzetti Dall'Aste Brandolini and Roberto Scazzieri, *The probability in Keynes: background and influences*. This book, as stated by the editors, presents the results of a reflection carried out starting from different disciplinary points of view on the contribution of John Maynard Keynes about the probability. It considers in historical, critical and bibliographical, the *Treatise on Probability* Keynes published in 1921.

Keywords: probabilità, Keynes, metodologie cognitive, strutture epistemiche.

Jel Classification: B41, B10

*** Università di Messina**

Introduzione

Questo contributo affronta il tema della probabilità in Keynes. La scelta del tema nasce dalla pubblicazione recente del volume curato da Silva Marzetti Dall'Aste Brandolini e Roberto Scazzieri, *La probabilità in Keynes: Premesse e Influenze*. Il volume, come affermano i curatori, raccoglie i risultati di una riflessione condotta a partire da differenti punti di vista disciplinari sul contributo di John Maynard Keynes riguardo alla probabilità. Esso considera in termini storici, critici e bibliografici, il *Treatise on Probability* di Keynes pubblicato nel 1921: con «l'intento è illustrare la ricchezza tematica e analitica del contributo Keynesiano, ed alcune sue influenze sulle successive riflessioni metodologiche e scientifiche».

Nella presentazione al volume viene ricordato come John Maynard Keynes, che è stato un economista ed anche un filosofo, abbia mostrato in modo concreto attraverso la sua riflessione, come il discorso di un pluralismo metodologico si presti ad equivoci, poiché la scienza, soprattutto la scienza moderna ha tra le sue conquiste maggiori l'unitarietà del metodo nella ricerca sia nelle scienze naturali, sia in una certa misura nelle cosiddette scienze umane.

E' abbastanza noto che sia Popper che Carnap hanno invocato un criterio di demarcazione fra scienza e non scienza riconducibile alla nozione di controllabilità dei rispettivi asserti. Controllabilità negativa, che può dirsi falsificabilità nel caso di Popper, oppure positiva nel senso della teoria dei gradi di conferma e della probabilità nel caso di Carnap. Alberto Pasquinelli, che è stato allievo di Carnap, avverte che proprio a questo concetto di controllabilità inteso nel senso di Carnap, Keynes con la sua opera sulla probabilità ha dato un contributo di chiarificazione decisivo, che, a tutt'oggi, è patrimonio comune di tutti gli epistemologi.

L'analisi del *Trattato sulla Probabilità* di Keynes

La prima parte del volume è una raccolta di saggi, per la precisione sette, curati da altrettanti Autori, in ciascuno dei quali è sviluppato un tema che riguarda la concezione keynesiana della probabilità. La seconda parte comprende invece due appendici ossia, una rassegna selettiva di recensioni del *Trattato sulla probabilità* dal 1921 al 1927, fra le quali ricordiamo quella del filosofo Bertrand Russel, al fine di rendere consapevole il lettore dell'attenzione prestata dagli studiosi di quel tempo all'opera di Keynes; e, nella seconda appendice, vi sono tre ampie e ricercate bibliografie su scritti economici, filosofici, politici e letterari di John Maynard Keynes su influenze e richiami in ambito epistemologico e probabilistico, nonché su influenze e richiami in ambito economico.

Obiettivo centrale del libro, secondo gli Autori, è proporre uno strumento di lavoro agli studiosi interessati alla considerazione delle strutture epistemiche su base induttiva, comuni a situazioni cognitive ed ambiti disciplinari diversi.

I saggi contenuti in questo volume suggeriscono quindi linee di ricerca collegate alla riflessione epistemica di John Maynard Keynes nel *Trattato sulla probabilità* ed identificano significativi nuclei di indagine sul piano logico-probabilistico ed economico.

Nel primo saggio "Keynes e la probabilità: Una sintassi dell'incertezza" Italo Scardovi spiega come Keynes nel *Trattato sulla probabilità*, è alla ricerca di paradigmi metodologici capaci di dare regole coerenti alle decisioni razionali in situazioni di incertezza, ponendo così l'attenzione sul carattere logico-induttivo della teoria keynesiana della probabilità. La probabilità è per Keynes un credere razionale è cioè una questione di logica e non di esperienza, di leggi formali e non naturali. Il calcolo delle probabilità per l'economista di Cambridge è lo strumento matematico per attribuire gradi di credibilità alle inferenze non dimostrative. Keynes rifiuta quindi ogni concezione "frequentista" della probabilità. Nella concezione della probabilità di Keynes entra di scena l'intuizione, si va quindi verso un soggettivismo probabilistico. Ma la probabilità logica di Keynes va letta sulla falsariga della convenienza, più che della conoscenza e misurata sulla scala dell'utilità, non su quella della verità. Una teoria quella della probabilità essenziale all'economia, una scienza che Keynes vede più vicina alla psicologia che alle scienze naturali, una scienza che avrà presto in lui

uno dei più accreditati innovatori. Egli verrà infatti ricordato come riformatore di uno schema dell'equilibrio economico generale, ma assai poco come imitatore di una linea originale di pensiero induttivo. Scardovi vede un nesso fra il *Treatise* di Keynes, dove è delineato il primo assetto logico-formale della concezione logica della probabilità, e Carnap¹ esponente di quella teoria generale delle influenze non dimostrative.

La teoria della probabilità in Keynes è quindi logica degli argomenti che sono razionali, ma non conclusivi. Keynes in sostanza non è mai troppo disposto a fare concessioni all'oggettività del caso, all'idea di un mondo naturale non rigidamente determinato o deterministico. Il significato della probabilità quale proprietà statistica di un evento è però estraneo al disegno di Keynes, che non sembra volersi accorgere di tutto un nuovo sapere cresciuto su fondamenti statistico-probabilistici, a cominciare dalla meccanica statistica classica (Boltzman, Maxwell, ecc.).

Anche Ramsey considera la teoria della probabilità come un ramo della logica, la logica della credenze parziali, dell'argomentazione non conclusiva, ma senza alcuna intenzione di implicare che questo sia l'unico e nemmeno il più importante aspetto dell'argomento. La scienza è la grande assente nella pur profonda teoria keynesiana della probabilità.

Tuttavia nelle ultime pagine del *Treatise on Probability*, Keynes sembra volersi interessare del tema della scienza e riconosce il fondamento statistico-probabilistico delle scoperte della fisica della particella e della genetica. Ma la probabilità statistica quale *modus intelligendi* della natura non piace a Keynes, che la considera uno strumento basato sulla logica per misurare l'incertezza nelle scienze sociali, di cui appunto, spiega in maniera corretta Scardovi, il *Treatise* costituisce il primo assetto logico-formale della concezione logica della probabilità.

Il volume prosegue nell'analisi della probabilità in Keynes. Nel saggio "L'Alchimia della Logica, Keynes versus Jevons", Maurizio Ferriani ricorda come Keynes dedicò alcuni saggi all'opera e alla figura di Jevons, di cui esprime un giudizio nell'insieme positivo ma controverso della personalità eclettica di economista e filosofo. Keynes e Jevons hanno tuttavia, sottolinea Ferriani, una concezione analitico-economica molto differente. Il primo formula l'innovativa teoria del valore utilità analizzando principalmente il meccanismo dello scambio, il secondo sposta viceversa l'attenzione sul terreno macroeconomico della domanda aggregata imperniando la sua teoria sulla propensione al consumo e all'investimento e alla sua preferenza per la liquidità, dando nel contempo grande rilievo alle aspettative degli agenti economici e al ruolo giocato dall'incertezza. Ferriani spiega quindi le tesi in campo epistemologico di Jevons contenute nei *Principles of Sciences* (1877). Tesi basate sull'induzione e sulle leggi classiche della logica (identità, non contraddizione e dualità). Per Jevons la probabilità appartiene per intero alla mente e in tal modo egli si discosta dall'impostazione empiristico-frequentista, accogliendo invece l'approccio alla probabilità di Laplace di trattare gli eguali in maniera uguale, di distribuire in modo paritario la nostra conoscenza e quindi anche la nostra ignoranza fra oggetti o eventi simili. Ferriani ricorda che Keynes nel capitolo VII del *Treatise* quando condanna l'irragionevole fiducia posta dai seguaci di Laplace nella regola di successione, cioè in una legge ottenuta in base ad un'adesione acritica del principio di indifferenza. Fra l'epoca di Jevons e quella di Keynes si afferma nettamente la concezione "frequentista" della probabilità, specie nella versione fornita da John Venn, in alternativa a quella classica che deriva da Laplace. Ferriani sottolinea come Keynes, per reagire al frequentismo dominante, riprenda certi aspetti della classica concezione epistemica della probabilità proposta da Laplace e accolta da Jevons, cercando di rivederne i fondamenti e l'articolazione teorica. In sostanza Keynes giudica i principi della teoria della probabilità di Jevons troppo fragili, astratti e ingenui. Ma sulla teoria della probabilità fra il Keynes del *Treatise* e quello della *Teoria generale*, è la tesi di Ferriani, c'è comunque continuità di temi.

Il terzo saggio è di Alessandro Vercelli, profondo conoscitore dell'opera di Keynes. Questo scritto dal titolo "Peso dell'argomento e decisioni economiche" cerca di definire il concetto di secondo ordine che ha come oggetto l'affidabilità evidenziale e probatoria della probabilità. Tale definizione

¹ Carnap (1962).

di “peso dell’argomento” è importante a giudizio di Vercelli, in quanto egli è convinto che tale concetto, che si associa all’incertezza in senso stretto, ha influenzato non poco la struttura teorica della *Teoria generale*. Vercelli si propone quindi di stabilire la rilevanza pratica del “peso dell’argomento” alla luce degli ultimi sviluppi della moderna teoria delle decisioni in condizioni di incertezza (TDI). Vercelli attraverso un *excursus* storico spiega che la TDI raggiunge la piena maturità soltanto con Von Neumann e Morgenstern (1944). Questo approccio mostra dei limiti sul piano empirico in quanto le probabilità sono date e vengono considerate dal decisore come «note» ovvero come perfettamente affidabili. Il “peso dell’argomento” non ha nessun valore pratico in quanto per assunzione è sempre e soltanto pari al suo valore massimo. Nei *Foundations of Statistics* del 1954 Savage presenta una TDI altrettanto rigorosa e sofisticata che pretende di essere applicabile a qualsiasi tipo di incertezza. In questa teoria soggettivista o personalista, spesso definita come «bayesiana», le probabilità sono pesi epistemici che assicurano la coerenza decisionale di un agente razionale.

Spiega Vercelli che la sistemazione classica dello stato dell’arte, che domina nelle rassegne e nei libri di testo, utilizza la distinzione fra probabilità note ed ignote per articolare una semplicistica divisione del lavoro tra teoria oggettivistica e teoria soggettivistica: quando le probabilità sono «note» viene ritenuto opportuno l’uso della teoria oggettivistica di Von Neumann e Morgenstern, mentre quando sono ignote viene consigliato l’uso della teoria soggettivistica di Savage. In sostanza se si esce dall’ipotesi di un mondo chiuso e stazionario la TDI può recepire le idee keynesiane sul peso dell’argomento e di conseguenza la questione se sia utile introdurre una misura dell’incertezza di ordine superiore al primo è dunque una questione puramente pragmatica e non logica. Vercelli cita alcuni suoi lavori in cui ha studiato la teoria delle decisioni in condizioni di incertezza con probabilità non necessariamente additiva. Quest’ultima risulta pertanto un importante riferimento per valutare l’accettabilità della teoria keynesiana del peso dell’argomento. Infatti, è l’interessante tesi di Vercelli, l’argomentazione keynesiana del “peso dell’argomento” è necessaria al fine di negare la capacità di autoregolazione del mercato in cui un’economia monetaria sofisticata, ed i recentissimi avanzamenti nella teoria delle decisioni in condizioni di incertezza e nella teoria dei valori di opzione permettono di rivendicare la sostanziale correttezza dell’argomentazione keynesiana. Questo saggio è quindi un contributo significativo nella direzione di valorizzare il programma di ricerca proposta da Keynes, inteso ad approfondire il ruolo del “peso dell’argomento” nelle decisioni economiche e collettive.

Vincenzo Fano, nel saggio “Keynes, Carnap e l’intuizione induttiva”, confrontando le concezioni epistemiche sulla probabilità di Carnap, esponente della corrente neopositivistica e del «logicismo» con quella di Keynes, dimostra come la posizione del primo nei confronti di quella dell’economista di Cambridge è in un primo tempo critica, in quanto tenta di eliminare dalla teoria della probabilità ogni riferimento all’intuizione. Negli anni successivi alla pubblicazione della sua *Logical Foundations of Probability* Carnap si muove però in una direzione diversa, moderando il suo estremo logicismo, riabilitando il valore epistemico dell’intuizione e quindi riavvicinandosi a Keynes, il quale nelle prime pagine del *Trattato* non esita a definire la probabilità come soggettiva, poiché si riferisce alle credenze che è razionale avere in determinate circostanze. Egli concepì la teoria della probabilità come teoria della conferma, cioè come una vera e propria logica induttiva. Secondo Keynes, la relazione fra l’ipotesi e l’evidenza empirica non può essere ulteriormente analizzata, perciò per determinarla bisogna affidarsi ad una sorta di intuizione. Nel saggio ricorre il termine «epistemico» con il quale si sottolinea il fatto che la nozione di probabilità non riguarda il mondo, ma la concezione del mondo. Di conseguenza i punti di vista logicisti di Carnap e Keynes, e quello soggettivista di Savage e De Finetti sono «epistemici». Popper invece definisce il punto di vista ontico, per il quale la probabilità non è più una relazione logica ma una proprietà reale, ossia la probabilità è un fatto reale. Fano cita la nozione di caso per evidenziare la differenza fra posizione di Popper e quella di Carnap e Keynes. L’Autore comunque a conclusione del saggio si schiera a favore di Keynes e Carnap in quanto sottolinea l’eccessivo impegno «metafisico» del concetto di *caso oggettivo* di Popper.

Eric Nasica e John Allen Kregel nel saggio “Alternative Analyses of Uncertainty and Rationality: Keynes and Modern Economics”, partendo da una concezione post-keynesiana, affermano che la questione centrale in Keynes, come del resto per Knight, è l’inadeguatezza della quantificazione statistica nella forma di una probabilità per l’analisi dell’incertezza. Nasica e Kregel, concentrandosi principalmente sugli eventi incerti in senso keynesiano, si occupano soprattutto di descrivere un sistema economico che si espande nel *tempo* in un contesto *storico*, così che il tempo dà il senso della sequenzialità delle azioni, evitando che si ragioni in astratto come se ogni cosa accada contemporaneamente. Le decisioni che riguardano azioni non reversibili e irreperibili rientrano nella categoria delle decisioni cruciali ed è proprio questa caratteristica che secondo gli Autori stabilisce una netta linea di demarcazione fra la teoria post-keynesiana e la moderna teoria neoclassica che considera il tempo come processo logico e quindi reversibile, in quanto basata sul rischio probabilistico. Neanche la nuova teoria classica, basata sull’ipotesi di aspettative razionali, può tenere conto dell’incertezza fondamentale di Keynes e Knight, in quanto in essa si assume non solo che il movimento del sistema economico abbia la natura di un processo stocastico stazionario, ma che esso sia anche *ergodico*, ossia che l’aspettativa Kregel sostengono che il mondo reale keynesiano non è ergodico, dato che le previsioni possono divergere dalle medie statistiche temporali e ciò dipende dal fatto che Keynes, diversamente dalla tradizione neoclassica, accoglie soprattutto nel *Treatise* (1921) una concezione induttiva e non soggettivista della probabilità. Per questo le due concezioni di razionalità keynesiana e neoclassica non coincidono. Keynes però non considera sempre irrazionali le decisioni prese in situazioni diverse di certezza e di rischio probabilistico, ma, fanno notare Nasica e Kregel a conclusione del loro saggio, Keynes considera nella *Teoria Generale*, come razionale, anche se in condizioni di incertezza fondamentale, il ricorso alle *convenzioni*.

Nel saggio “Bene morale e condotta giusta: la politica economica di John Maynard Keynes” Silva Marzetti Dall’Aste Brandolini concentra l’attenzione sugli aspetti filosofici del pensiero di Keynes: cercando infatti di stabilire cosa sia una condotta giusta, ci si occupa di cosa sia, più in generale, il bene morale. Per questo l’Autrice del saggio riprende quegli aspetti che riguardano la disputa tra teoria classica e teoria keynesiana, teorie economiche che appunto considerano la scienza economica come *moral science* anche se su principi ben diversi. Analizza quindi il pensiero filosofico edonista, in particolare quello utilitarista di Bentham, poiché a tale autore Keynes fa riferimento quando rifiuta la concezione del bene come piacere. Si considera anche il pensiero di G. Moore riguardo ai concetti di bene morale, di condotta giusta e di probabilità, dove il bene morale viene definito nei suoi *Principia Ethica* (1903) quale «stato della mente». Moore critica l’edonismo in quanto conduce necessariamente all’egoismo, quindi egoismo ed utilitarismo (che riguarda il bene in generale) sono due criteri di moralità necessariamente contraddittori. Sulla natura della bontà etica Moore e Keynes si trovarono d’accordo, mentre sulla «condotta giusta» Keynes ebbe molto da ridire, come del resto sul fondamento etico dell’utilitarismo benthamiano. Vengono poi analizzati alcuni aspetti del pensiero filosofico keynesiano ed i suoi nessi con il suo pensiero economico. Si analizzano inoltre il ruolo del principio di organicità ed il concetto keynesiano di bene morale; il ruolo assegnato da Keynes allo Stato ed altri interessanti argomenti fra cui il tema relativo alle ragioni che giustificano dal punto di vista filosofico la macroeconomia keynesiana. Un saggio quindi complesso e composito, quello della Marzetti Dall’Aste Brandolini centrato, su questioni di natura filosofica ed economica, ma certamente di grande interesse per il quadro di analisi storica dei problemi trattati.

Nell’ultimo saggio del volume “Analogia, fiducia, e società civile: la struttura morale della probabilità nel contributo di John Maynard Keynes”, Roberto Scazzieri riconsidera il *Treatise on Probability*, in quanto riflette la discussione cantabrigense nell’ambito delle *moral sciences* e permette di collocare il contributo di Keynes alla teoria economica in un preciso contesto di teoria dell’azione umana. Scopo principale del saggio è «esaminare il collegamento del *Trattato* sulla probabilità da un lato con gli aspetti cognitivi delle scienze morali e, dall’altro, con le riflessioni di Keynes in tema di analisi economica; dei suoi presupposti istituzionali (la società civile) e dei suoi

criteri direttivi sul piano etico (il principio della benevolenza attiva)». La seconda sezione del saggio 'Al confine tra matematica ed i problemi fisiologici', Scazzieri considera la formazione intellettuale di John Maynard Keynes con l'obiettivo di individuare la matrice degli interessi di Keynes per gli aspetti epistemici e pratici della razionalità proprio nell'area di confine fra *sciences* e *humanities*. La terza sezione del saggio affronta questioni concettuali relative al *Treatise on Probability*, quali l'induzione, l'analogia, le procedure epistemiche, prendendo in esame nello specifico il contributo keynesiano allo studio delle procedure cognitive e dei loro riflessi sulle caratteristiche dei sistemi intersoggettivi di costruzione della conoscenza. Riguardo al termine «induzione» esso si collega ad alcune caratteristiche delle influenze analogiche, dove la «semplificazione empirica» di un'idea astratta richiede l'individuazione di elementi comuni fra una proprietà sintetica (espressa dall'idea astratta) e un agglomerato contingente di caratteristiche (che consente la semplificazione empirica). Scazzieri chiarisce bene i concetti di somiglianza e varietà (empirica), che sono indispensabili nelle procedure di conoscenza indiretta utilizzati da Keynes nelle procedure cognitive razionali. La *somiglianza* rende possibile il trasferimento analogico di conoscenza, mentre la *varietà* consente il trasferimento di conoscenza fra casi individuali sufficientemente distanti e quindi determina in modo significativo lo «spessore informativo» della conoscenza che si viene in questo modo ad accumulare. Scazzieri prende in considerazione i processi di formazione della conoscenza indiretta di Keynes e li riconsidera alla luce della sua analisi della società civile, che sviluppa nella quarta sezione in riferimento anche alle strutture epistemiche e alle relazioni intersoggettive che si possono configurare alla base della società civile stessa. Scazzieri individua negli stessi criteri epistemici di somiglianza e varietà quel nucleo di proprietà generatrici all'origine della società civile, rinviando, quindi ad una struttura cognitiva fondata sull'induzione analogica. Richiamando R. Cumberland, l'Autore spiega il principio attivo della benevolenza tra probabilità e fiducia per «spiegare» la società civile e richiama la posizione di Keynes su tali argomenti. La società civile viene definita come struttura epistemica «aperta», cioè come un insieme coerente di criteri che consentono l'utilizzazione non predeterminata delle informazioni nelle relazioni fra soggetti. La tesi che Scazzieri vuol dimostrare è che attraverso la ricostruzione razionale di una struttura epistemica fondata su analogia, induzione e benevolenza attiva, è possibile individuare un approccio al governo dell'economia lontano da una concezione costrittiva della legislazione e individuare la possibilità di azioni di *policy* che abbiano carattere diretto senza essere costrittive, definendo attraverso azioni locali di benevolenza attiva uno spazio decisivo di libertà di scelta, coordinamento orizzontale e principio di varietà.

Conclusioni

Il volume, di cui abbiamo tracciato i contenuti più significativi, è ricco di spunti per l'analisi della probabilità e per l'analisi economica, essendo le due fortemente collegate, ma va oltre questo obiettivo di natura analitico interpretativa. Esso infatti tenta di tracciare, partendo dall'opera di Keynes, nuovi percorsi per una struttura epistemica fondata su alcuni concetti che consentono di individuare un modello di società aperta che preservi i vantaggi dell'individualismo, che mantenga un utilizzo e una gestione non predeterminata delle informazioni e delle relazioni fra soggetti, senza tuttavia rinunciare ad un modello di governo che miri all'accrescimento del bene complessivo della società.

Riferimenti Bibliografici

Carnap R. 1962. *Logical Foundations of Probability*, Chicago, University of Chicago Press.

Jevons, W.S. 1877. *The Principles of Science: A Treatise on Logic and Scientific Method*, 2nd and final edition, reprint, New York: Dover Publications, 1958.

Keynes J.M. 1921. *A Treatise on Probability*, London, Macmillan & co.

Marzetti Dall'Aste Brandolini S., Scazzieri R. (a cura di), 1999. *La probabilità in Keynes: Premesse e Influenze*, Bologna, Cleub.

Moore G. 1903. *Principia Ethica*, Cambridge, Cambridge University Press.

Savage L. J. 1954 *The Foundations of Statistics*, New York, John Wiley and Sons.

Schilirò D. 1987. Il modello IS-LM e la reinterpretazione di Hicks. Una nota", *Economia Politica*, n.3, pp.421-435.