

一橋大学博士(経済学) 学位論文要旨

不足と家計行動の経済分析—ソ連経済への数量経済史的接近—

志田 仁完

2015 年 2 月

1. 本学位論文の背景

ソ連経済は、「ソ連型計画経済」(Soviet-type)とも称されるように、経済体制論の分野において社会主義経済体制の基本的類型として取り上げられ、これまで、その実際の作動や問題に関して広範な議論が繰り広げられてきた。ソ連崩壊を経た現在では、歴史的事実の解明という観点のみならず、市場経済移行の初期条件や社会主義の歴史的「遺産」(legacy)の影響という現在と直結する問題意識からも研究が継続されている。ロシア革命 100 周年を目前とした最近年において、歴史的再検討の動きは一層活発になるばかりであり、数多くの新しい成果が発表されている。このような研究活性化の一因が情報公開の進展にあることは言を俟たない。入手可能となった新資料の活用は、既存の研究課題のより深部にいたる再検証を可能ならしめると同時に、研究領域の拡大や新しい課題を提起している。本学位論文もこの時代状況を背景に、ソ連の成立と崩壊という 20 世紀を象徴する世界史上の一大イベントに対して経済史的再検討を試みる。

その中でも本学位論文は、消費者の厚生面からソ連経済システムに接近している。ソ連家計は、第二次世界大戦後の経済復興を経て初めてロシア革命以前の水準を上回る消費生活を手に入れた。欧米の市場経済諸国と比べれば依然低水準にあったが、消費生活は確実に豊かになった。しかし、それと同時に、モノ不足の問題が深刻化していったと考えられている。行列に象徴される不足の存在は、まさにソ連経済を特徴づける最重要な側面の 1 つであり、看過できない問題である。しかしながら、資料制約を主たる理由として、不足問題が実証的な意味で十分に検証されてきたとは言い難い。この既知の問題がソ連家計に如何なる影響を及ぼしていたのかに関して、新資料を用いて、また見逃されてきた観点を導入しながら取り組むことが本学位論文の研究課題である。各章の概要に沿って、説明していく。

2. 本学位論文の概要

本学位論文は2部構成をとり、第Ⅰ部において先行研究のサーベイを通して問題の確認とその分析のための枠組を提示し、この前提の下で、第Ⅱ部で筆者自身の実証分析を進めていく。

第1章

第1章では、本学位論文全体を通して検討する消費問題が何か、ソ連経済においてこの問題はどのように位置づけられるかを確認し、その問題の発生が必然的であったことを計画制度の分析を通して説明している。初めに、ソ連崩壊を経た現代に直結する第二次世界大戦以降の長期消費動態を概観し、「絶対的な欠乏」から「相対的な不足」とも表現しうる消費問題の変化が生じたことを確認した。消費水準の上昇に伴い、量・質両面で消費者の要求が増大し、消費の対象範囲拡大やニーズの多様化といった「消費の高度化」のプロセスが進展した。計画経済システムは消費者自身の意思決定を計画化と国家管理の直接の対象とすることはできない。家計が保有する貨幣の処分方法は家計の裁量の下にある。そのため計画体制にとって、消費者の需要を反映した消費財の供給を計画化すること自体が困難な課題となる。この条件の下で進展していった消費の高度化は不可避免的に消費計画化を一層困難なものにした。消費の高度化が、計画対象品目の範囲や種別の増大、そして常に化する消費者需要への柔軟な対応を計画経済システムに要求するからである。また、消費問題は所得水準上昇によってだけでは解決困難な問題でもあった。所得の追加的な増大は消費の際の家計の自由度(自由に処分できる貨幣量)を増大させると同時に、消費の高度化をさらに進展させる。その結果、消費に対する計画的な制御は一層の困難なものとなるからである。しかし、経済停滞や生産効率の低下に苦しむソ連政府のとった経済政策の1つは、賃金メカニズムを改善し、賃金をもつ労働インセンティブへの刺激効果を強化し、生産性を上昇させ経済成長を促そうというものであった。所得の増大それ自体は家計の厚生を上昇させる。一方で、家計の消費需要に十分に対応した財の供給が伴わない限り、追加的な所得は財の購入資金として利用できない。この場合、賃金政策はかえって労働意欲を削ぐという負のフィードバックをもたらすことになる。以上のような経済循環を考慮すれば、不足は家計にのみ影響する問題ではなく、ソ連経済システムの持続可能性に対しても負の影響を及ぼす重要な問題として捉えられる。このようにして本学位論文で取り組むべき課題としての消費問題の中心が、家計が直面する不足の問題にあることが説明される。

以上の問題提起を受けて、消費者の需要と消費財の供給の合致を図るうえでどのような制度が計画経

济体制に組み込まれていたのか、そこで生じた不足問題は不可避免的であったのかを、商業部門を中心とする消費財供給の計画化制度の観点から概観した。商業部門の役割は、生産部門と消費者を仲介し、消費者の需要を生産計画に反映させることにある。そのために、多様かつ複雑な部門別・地域別管理体系の下で、分節化された一定の範囲の消費者の需要を、貨幣面・構成面の双方において供給と合致させるような制度が設計されていた。この際、最も重要な役割を委ねられていたのが末端の商業企業であり、商業企業は消費者の需要を反映するように生産企業と契約関係を締結することが要求された。しかし、この契約は自由選択的取引関係に基づくものではなく、計画機関による生産企業への商業組織の強制的な固定によって行われた。そのため、不足経済の売り手市場の条件下では、商業企業は生産企業の利益に従属し、消費者の利益に応えるインセンティブを有していなかった。以上の制度設計の概観が有する含意は2点ある。1つはソ連経済における不足問題発生 of 必然性である。もう1つは、公式市場のセグメント化である。一定範囲の消費者を対象とする地域レベルの市場均衡を前提として、ソ連全体における均衡が成立する以上、ソ連の消費市場分析は下位の地域レベルを対象とした上で、集計化されたソ連経済システムを議論しなければならない。

第2章

以上の制度分析を通して、計画経済システムに不足問題が必然的に生じたことが理解される。しかし、不足がどの程度深刻であったのかを検証することは方法論的に困難であり、その結果、ソ連家計に対する影響を議論することも容易ではない。そこで、第2章では、先行研究の整理を通して、不足の「鏡像」とも表現できる「強制貯蓄」(forced savings)概念に基づいたソ連の家計行動の分析枠組を示した。強制貯蓄とは公式市場の価格上昇を伴わない抑圧型インフレーションの結果、住民が望む以上に過剰な流動資産が留め置かれることであり、支出したくても支出できないために形成される非自発的な貯蓄を意味する。価格が国家によって設定され、需要と供給によって決定されないため、超過需要が価格上昇をもたらさず、そのまま残存することになる。第1章の制度分析が含意する消費市場における不足の発生 of 必然性という前提に立てば、不足が深刻化している状況において生じている「過剰」な貯蓄を計測することによって、ソ連家計が直面していた不足の深刻度を検証することが可能となる。しかし、不足が必ずしも強制貯蓄に直結するとは限らないことが問題となる。公式市場で充足されない需要も非公式経済＝第二市場で吸収される可能性があるからである。いずれの見解においても実証分析を可能とする十分な統計資

料へのアクセスが難しく、ソ連存在当時の議論は多くの場合解釈論に終始していたといえるであろう。

そこで、先行研究を整理し、改めて強制貯蓄発生メカニズムを明らかにし、第Ⅱ部第3章以降における筆者自身の実証分析に必要な要因を取り出すことが本章の課題となった。サーベイを通して、(1)公式市場における不足の発生、(2)第二市場の存在、(3)不足に直面した際に家計が第二市場へ移動するか否か、の3点が強制貯蓄の存在の是非を決定する要因であることが明らかとなった。特に、(2)第二市場が存在するとしても、不足財に対する未充足需要を吸収する能力があるか、(3)消費者の移動が十分であるかが重要となる。本章では、これらの3要因を統合して「市場」の特性として分類し、強制貯蓄発生メカニズムを整理している。当然不足が存在しなければ強制貯蓄は存在しない。そして、不足が発生した場合でも、第二市場が不足を吸収する能力を十分に備え、家計も第二市場へと移動することが容易であれば、強制貯蓄は存在しない。過剰な貯蓄の増大は、第二市場で利用可能な取引の資金となる。この対極に位置する「市場」が、第二市場が存在しない経済構造であり、この際、不足下で増大する貯蓄は強制貯蓄とみなされる。この中間に第二市場が存在してもなお強制貯蓄が発生する「市場」類型が位置づけられた。その1つは第二市場が公式市場の不足を十分に吸収することができる潜在力を有しているにもかかわらず、家計行動がそれに適応していないケース、そしてもう1つの類型が、第二市場に未充足需要を吸収する潜在的能力が十分に備わっていない、また公式市場から第二市場への家計による行動転換も不十分なケースである。両ケースにおいて強制貯蓄は発生する。しかし、その説明方法は異なる。ソ連の分析においては、上記3要因それぞれに検証を加え、その総体としての「市場」がどのような特性を有していたのかを明らかにすることによって、はじめて強制貯蓄の議論が可能となる。

以上の第Ⅰ部では、本学位論文が分析対象とする消費市場の分析単位が、ソ連全体ではなく、地域単位となるという含意も導かれた。第1章では、公式市場の均衡のために地域別管理体制がとられていると説明された。このことは、消費市場がソ連全体において均衡を達成するためには、その下位レベルの均衡が前提条件となることを意味する。ある地域における超過供給が、他の地域に発生した超過需要によって集計化(相殺)されてしまえば、消費問題を捕捉できない。そのため、公式市場の不足状況を検討する際に、分節的に計画管理される地域の市場を考慮した上で、ソ連全体の問題を検討する必要がある。一方で、第2章からも間接的であるが、地域分析の必要性が示唆される。公式市場と第二市場の双方へのアクセス可能性を保証するような地理的範囲に限定しなければ、第二市場による強制貯蓄の解消メカ

ニズムを想定できないからである。不足に直面した消費者が公式市場で行列を形成するか、第二市場に参入するかを、自発的に選択できるためには、両市場に同時的にアクセス可能でなければならない。領土の広大なソ連において、消費者が極めて高い移動性を有していなければ、特定地域の第二市場の発展は、遠隔地域の過剰な貯蓄の解消に影響を及ぼしえない。

第3章

第3章の課題は、強制貯蓄分析の第1段階の準備作業として、実証分析に必要なデータベースを構築し、第二市場の規模を統計的に捕捉することにあった。先行研究における強制貯蓄の議論では、ソ連に公式経済以外の非公式経済＝第二経済が存在することが重視されていたが、第二経済と其中的の市場機能である第二市場との区別が明確ではなく、地域的な相違に関しても十分な注意が払われていなかった。そのため、地域レベルの第二経済の規模・構成・時系列的推移を捕捉し、強制貯蓄の解消機能としての第二市場を抽出する必要があるが生じる。そこで、アーカイブ所蔵の家計調査統計に基づき、1965－1989年という消費の高度化と不足が深刻化した時期に対応する期間の家計データを整備し、その中から家計の第二経済活動と第二市場活動を特定した。第二経済は、(i) 私的な利益を直接の目的とする、(ii) 合法性を認識している、の2条件のいずれかを満たす全ての経済活動として定義される。この定義に従い、家計において社会主義セクターと私的セクターの活動が区別される。さらに、現物所得・自家消費と貨幣取引が区別される。また、財・サービスの貨幣取引は、対国家取引と市民間の直接取引が区別された。以上の第二経済の構成要素の中で、市民間の直接の貨幣取引は、その取引価格が需給により決定されるという点で、国家による価格設定とは異なっているため、第二市場であると定義される。第二経済を構成する要素の分解を踏まえて、第二経済の構成と時系列的推移に関して、スラブ、中央アジア、コーカサス、バルトの4地域の比較分析を行い、構成共和国間の相違を明らかにした。第二経済の規模が最も大きいコーカサスにおける第二市場の規模は、第二経済の規模が最も小さいバルトの第二経済全体の規模を上回っている。また、第二経済の規模が小さいバルトやスラブでは、第二市場の縮小傾向に伴い、第二経済全体の規模も縮小しているのに対して、中央アジアの第二市場の推移は安定的であり、コーカサスでは拡大傾向が確認された。第二経済の現物部門の推移は比較的安定しており、第二市場の推移が各構成共和国の時系列的推移を決定する要因の1つとなっていた。以上の分析の結果、(1) 小規模の第二経済が存在し、その縮小傾向も著しいバルトとスラブ、(2) 規模の大きい第二経済が存在し、縮小傾向が比較

的穏やかであった中央アジア、(3)第二経済の規模が最も大きく、さらに第二市場の相対的な拡大によって第二経済全体の成長傾向が支えられていたコーカサス、という地域レベルの第二経済の構造と時系列的推移における相違が示された。この事実発見は、セグメント化された公式市場と同様に、第二市場を内包する第二経済にも、地域的な市場特性の相違が存在することを示している。特筆すべきは、不足が発生を喚起するはずの第二市場が、相対的に不足レベルが低いと予想される中央アジアやコーカサスで最も発展していたことである。このことから、不足と第二市場がいかなる関係であったのか、地域間で構造的関係に差異があったのかを実証的に分析することが要求される。

第4章

第4章では、上記の問題に回答するために、1965－1989年の構成共和国パネルデータを用いて第二市場と公式市場の不足との関係に関して実証分析を行った。本章の中心的な課題は、公式市場における不足が第二市場の拡大を喚起したか否かを検証することにあつた。不足が第二市場の規模に正の影響を与えるのであれば、第二市場は不足に起因する強制貯蓄を解消する機能を有していると理解される。しかし、このような両者の直接的な因果関係を想定する際に、見逃されている観点がある。それは、両者の関係は、不足から第二市場への一方向的なものだけではなく、第二市場から不足へという反対方向でも存在するという観点である。第二市場が公式市場の不足を吸収するのであれば、公式市場の不足が緩和され、結果として第二市場の規模も縮小する。また、第二市場の拡大には、公式市場からのリソースの移動が必要となる場合があり、公式市場の不足が第二市場の拡大の障害となる場合や、第二市場の拡大によって公式市場の不足が深刻化するケースが考えられる。そのため、不足と第二市場を両方向的な関係として検証する必要が生じる。本章では、この問題を検証するために、上記それぞれの方向における関係を検証したうえで、両者の双方向的な関係を分析した。

固定効果モデル、操作変数法、3段階最小2乗法による分析の結果、不足は第二市場の拡大を喚起したことが確認された。ただし、その裏側には、第二市場が不足を悪化させるという関係も存在していたことが明らかとなった。さらに、両者の双方向的な構造関係に関して、内生性を考慮した同時方程式モデルで推定した結果、第二市場と不足は悪循環構造を形成していたことが示された。このことは、計画経済システムの機能不全、とりわけ公式市場の不足の悪化が代替的・補完的経済メカニズムとしての第二市場の拡大を喚起したとしても、第二市場の拡大は公式市場の未充足需要の解消には寄与しない可能性がある

ことを含意している。さらに、地域間比較分析の結果、この悪循環構造は、ソ連を通して一般化できる経済構造であるとはいえ、関係性の強さには地域間に大きな相違があることが確認されている。即ち、スラブ及びバルトといった相対的發展地域では、第二市場の拡大がより深刻な不足に帰結する一方で、中央アジア及びコーカサスでは、第二市場の発展が公式経済部門とはより独立的であり、不足に対する第二市場の影響もより小さい。不足と第二市場の構造的関係も地域的な相違性を有しており、強制貯蓄問題の地域レベルにおける分析の必要性を強調する議論を導き出している。

第5章

第5章では、本学位論文の最後かつ中心的な分析として、強制貯蓄の実証分析を行った。第2章の議論を踏まえて、不足経済下の家計貯蓄は、不足に起因する非自発的貯蓄、第二市場を志向する自発的貯蓄、そして不足に直面した家計が第二市場において貨幣を利用する需要のスピルオーバーの3つの要因の影響を受けると想定される。そこで、本章では、(1)不足要因、(2)第二市場要因、(3)相乗効果(スピルオーバー)の3要因とライフサイクル要因を導入し、家計貯蓄率の決定要因に関するパネルデータ分析を行った。また、第二市場の規模における地域差(第3章)、不足と第二市場の関係性における地域間の構造的な相違(第4章)の2点が含まれる「市場」特性における地域的相違性(第2章)を考慮して、家計貯蓄率と強制貯蓄率に関する構成共和国間・地域間の比較分析を行った。

分析結果は、家計貯蓄率の決定におけるソ連の特異性を明らかにしている。即ち、ソ連家計の貯蓄率の決定には、(1)不足要因、(2)第二市場要因、さらに、(3)両者の相乗効果、という市場経済とは異なる3つ要因が影響している。公式市場の不足は非自発的な貯蓄を喚起し、第二市場は取引動機としての貯蓄を増大させる。これら2要因がソ連家計の貯蓄率の上昇要因となる。第二市場要因は自発的貯蓄を増大させるように機能するため、貯蓄の過剰とも見える増大のみに着目して、強制貯蓄が増大していたと主張することはできない。一方で、公式市場で充足できなかった需要を構成する貯蓄の一部は、第二市場に移転して利用されるという相乗効果(スピルオーバー)の存在が、ソ連家計の貯蓄率を引き下げる。この相乗効果は、不足に伴う貯蓄の強制性の一部を緩和するメカニズムとして機能している。従って、非自発的な動機に基づく強制貯蓄とは、不足によって生じた貯蓄のうち、相乗効果によって解消されない貯蓄として捕捉することが可能となる。そこで、推定結果に基づき、グロスとネットの2種類の強制貯蓄率を算定した。グロスの粗・強制貯蓄率は不足の直接の結果として生じる貯蓄率である。一方で、ネットの純・強制

貯蓄率は、相乗効果をグロスの粗・強制貯蓄率から差し引いた貯蓄率である。純・強制貯蓄率の算定結果から、ソ連全体レベルにおいて、強制貯蓄が 80 年代以降に急増傾向を示し、ソ連末期には貯蓄の 4 割にも達したことが明らかとなった。この 4 割にまで達した純・強制貯蓄率が不足の趨勢的増大と、経済システムにおける消費問題の深刻化を反映している。ただし、不足によるこの強い負の影響は地域レベルで異なる。上記 3 要因に地域差が存在し、「市場」特性も地域的に異なるためである。筆者の推計は、ソ連末期において、不足がより深刻であり、第二市場が相対的に小さいスラブやバルトでは強制貯蓄率が貯蓄の 3～5 割にも及んだ一方で、第二市場が発達した中央アジア・コーカサスでは 1 割以下である、という明確な地域的分化を示している。

結論

以上で要約した第 1 章から第 5 章までの議論から導かれる本学位論文の結論は次の通りである。本学位論文では、ソ連経済システムを不足、第二市場、強制貯蓄という家計行動に焦点を絞り再検討を行った。その結果、ソ連経済は不足経済であり、それが強制貯蓄の発生を喚起し、経済システムを不安定化させたという理解が得られた。しかし、この主張はあくまでも地域的差異を集計化したソ連全体に関する主張であるという限定性を伴っている。セグメント化された公式市場と第二市場により形成される「市場」特性の地域差を考慮して、構成共和国レベルの比較分析を行った結果、不足問題、第二市場の発達、そして強制貯蓄の発生には構造的な地域差が存在していたことが明らかになったのである。その結果として、ソ連経済は異なる特徴の消費市場を有するモザイク状の経済システムであった、という特徴づけが与えられる。

3. 本学位論文の主要な成果と意義

本学位論文の意義と成果は、数量経済史的アプローチによってソ連経済を実証的に再検討していることに関係している。第 1 の成果は、家計分野に限られるが、アーカイブ所蔵の機密解除資料に基づき、比較的長期の、また構成共和国横断的な歴史統計を利用可能な形態に再構築した点にある。本学位論文第 3 章では家計調査統計を構成共和国間で比較可能な形式に整備し、Appendix 1 では、住民貨幣収支バランスを同様に整備している。家計に関係する統計資料は、特に機密性が高く、従来アクセスが難しかったため、このような作業を通して家計行動の実証分析と構成共和国の比較分析が初めて可能となった。

第2に、この前提において、構成共和国の比較分析を行い、ソ連経済システム内部における地域的多様性を明らかにしている点に、本学位論文の意義が求められるであろう。管見の限りでは、パネルデータに基づく不足・第二市場・強制貯蓄のそれぞれに関する実証分析は本学位論文が初めての試みである。また、そこではソ連経済の一般的な構造的特性と地域的相違が同時に明らかにされ、ソ連崩壊後独立した旧ソ諸国の移行という劇的な社会経済的変化の初期条件に及ぼしうる相違も含意として導き出されている。移行の初期条件を議論する際、多くの移行経済研究では、経済発展度や産業構造等の分析に止まっており、社会主義経済を最も特徴づける不足や第二市場といった要因に関しての相違を十分に考慮しているとは言えない。本学位論文第3章では、第二経済の規模と構造の相違を明らかにし、第4章では、第二市場と不足の発生要因と双方向的構造における地域的相違を示した。第5章においては、強制貯蓄の規模やそれを説明するメカニズムの地域的差異を明らかにしている。これらの分析は、ソ連期の第二経済と移行期の非公式経済の連続性・断絶性、ソ連期の超過需要の蓄積と移行期のハイパーインフレの関係を検証するための素材を提供していると考えられる。