

一般利潤率의 確率的背景

金 俊 輔

—

古典學派의 價格構成論에 依하면 自由競爭의 前提下에 商品價格은 이론바 自然價格을 中心으로하여 需要供給의 法則에 따라서 不斷히 動搖한다. 그리하여 勞動價值說에 있어서는 周知하는 바와같이 自然價格은 生産價格(費用價格+平均利潤)이 되어있고, 生産價格을 構成하는 平均利潤은 그 社會에 形成되는 一般利潤率(allgemeinen Profitrate)에 照應되어 있는 것이다. 이理論을 좀더 整理하여 말하고보면 다음과 같다.

- 1) 自由競爭이 完全한 一定한 段階의 資本主義社會에 있어서는 資本의 有機的構成度の 差異에도 不拘하고, 資本의 自由的 移動의 結果 投下 資本에 對하여 同一水準의 利潤率, 即 一般利潤率이 形成되고,
- 2) 各商品販賣에서 期待되는 利潤은 그 商品의 費用價格에 一般利潤率을 乘한 結果로서 얻게되는것이며, 따라서 諸商品의 價格은 그 商品에 具現된 價値를 그대로 反映하는것이 아니라 그의 生産價格에 基準을 갖는다.
- 7) 여기에 있어서 이론바 價値法則의 歪曲이 있게되는것이나(여기에 勞動價值學說에 對한 根本的批判의 對象이 숨어있음은 周知의 事實) 그럼에도 不拘하고 『諸商品의 生産價格의 總計는 그의 價値의 總計와 같다』(「資本論」第 3卷上, 高崙譯 P.130)

더욱 흔히 보는바 以上の 內容을 數表로서 例示하면 아래와 같다. (全上(P.127))

	剩餘價值率	剩餘價值	利潤率	消費 C	商品價值	費用價格	生產價格	
I 80C+20V	100	20	20	50	90	70	92	
II 70C+30V	100	30	30	51	111	81	103	
III 60C+40V	100	40	40	51	131	91	113	
IV 85C+15V	100	15	15	40	70	55	77	
V 95C+ 5V	100	5	5	10	20	15	37	
390C+110V	—	110	110	202	422	312	422	計
78C+22V	—	22	22	—	—	—	—	平均

(C: 不變資本, V: 可變資本)

위의 表에서 보면 一定한 剩餘價值率(100%)下에 社會的 (5個生産部門)으로 形成된 一般利潤率은 22%로 均平化하여있고, 總生産價格과 總價值는 422로서 一致되어 있는것이나, 그러면 여기에 물건데 위의 一般利潤率의 形成은 個別的商品에 關하여 市場價格의 形成에 先行的인것인가 또는 後行的인것인가?

만약 一般利潤率이 商品價格의 形成에 先行하지 않는다면 (反對로 商品價格이 先行的으로 주어진 것으로서 認定한다면) 一見 우리에게는 生産價格을 말하는것이 無意味하게되고, 價值法則은 全的으로 그의 意味를 喪失하게 된다. 왜냐하면 만약 商品價格이 一般利潤率의 形成에 先行된다할진데 本來 價格構成의 要因을 밝히려는 生産價格의 觀念이나 또는 價值法則의 目的은 모름지기 本來의 對象을 잃게되기 때문이다.

그러나 도리켜 생각하면 우리는 即時 一般利潤率을 形成시키는 資本의 自由的인 移動誘因을 商品價格의 形成以前에 求할수 없는것도 事實이다. 그는 곧 個別의 企業의 立場에서볼때 利潤率의 高低는 商品價格이 決定됨으로써 비로소 認定되고, 具體的 資本의 移動은 商品價格을 前提로 하는 까닭이지마는 이點을 좀더 確實히 말하면 다음과 같은것이다. 即「商

品의 一部가 그의 價値以上으로써 販賣되는것과 마찬가지로 商品의 他一部가 그 價値以下로써 販賣된다. 그리하여 商品이 이와같이 販賣됨으로써만이 I로부터 V까지에 이르는 各資本의 利潤率은 有機的 構成度의 差異에 關係없이 均等히 22「퍼센트」로 되는것이다』(全上 P. 128) 그리고 『平均利潤은 利潤의 하나의 平均率에 依하여 決定되지않으면 아니된다. ……不等的 諸利潤率을 이와같이 均衡化시키기 爲하여서는 利潤이 미리 商品價格의 要素로서 存在함이 要求되는 것이다』(「同上」下, P. 400)

* 이 밖에 많은 解説書에 있어서 같은 趣旨의 文面을 볼수 있다. 例 「숨페타 一」; 「經濟學史」, 日譯 P. 209, 「經濟學教科書」日譯 P. 263, 大內; 「經濟學」岩波全書 P. 109, 宇野; 「經濟原論下」P. 58 等.

그러나 한편 위의 引用文에 뒤이어서 우리는 若干 反對的인 다음과같은 文面에 接하는 것이나 이러한 事情은 곧 다음에서 알수있을 것이다. 『競爭은 利潤을 만들어 내는것은 아니다. ……그리하여 우리들의 利潤의 하나의 必然率에 關하여 말할때 알고자 하는것은 마치 競爭上의 諸運動으로부터 獨立된 利潤率, 오히려 競爭을 調節하는 利潤率이다. 云云』(全上 P. 400—401)

二

果然 商品의 市場價格이 平均利潤의 形成, 따라서 一般利潤率의 形成에 앞서서 形成됨을 要求한다는 것은 個別的인 經濟主體의 活動을 微視的인 立場에서 살펴 볼때 오히려 當然하다 할수 있다. 그러나 한 거름 나아가서 問題를 巨視的으로 살펴 본다면 그의 展望은 逆轉하는 것이다. 그리하여 個別的 經濟主體의 關與如何에 不拘하고, 一定社會의 一定한 時間的段階에는 어떠한 共通的인 利潤率의 先行的으로 形成되어 있음을 보게 된다. 오히려 이때에 우리는 個別的 經濟主體의 投資活動을 社會的 一般利潤率의 前提下의 行動으로서 把握할수 있게되는것이다.

그러면 나아가서 個別的 經濟主體의 活動의 集合의所産인 一般利潤率이 反對로 個別的 經濟主體의 活動에 對하여 調節의 基準으로서 나타난다는 事理는 어디에 있는것인가? 그것은 곧 個別的인 行動에는 偶然性이 支配되어 있음에도 不拘하고, 그의 全體的인 集團現象에는 一定한 規則性이

나타난다는 大數의 法則이 支配되는 까닭인 것이니* 여기에 바로 個體의 活動과 全體의 形成을 同時的으로 把握할 수 있는 契機는 숨어있고, 이에 依하여 一般利潤率(規則性)의 形成을 確率的으로 考察하는 實質的意味는 發見될 수 있는 것이다.

* 『競爭의 部面은 個別的인 경우에 있어서 이를 보면 偶然에 依하여 支配된다. 이리하여 거기에 있어서는 이들 偶然을 通하여 實現되고, 또한 이들 偶然을 調整하는 內面的 法則은 이들 偶然이 大量的으로 總括되는 경우에 限하여 눈에 나타나게 되는 것이며 또한 거기에 있어서 이 法則은 個別的인 生産當事者 그 自身에 對하여서는 依然 눈에 보이지않고, 理解할 수 없는 것이다』(同上, P.366)

一般利潤率의 形成을 위와같이 大數의 法則下에 確率的인 條件으로서 理解함으로써 우리는 앞의 問題——價格과 一般利潤率의 先後規定의 問題——를 具體的으로 解答할 수 있게된다. 그러나 한편 우리에게 있어서 단순히 確率的인 條件 그것만을 찾아본다면 非但 그는 一般利潤率에 限해있는 것이 아니다. 그는 어떠한 意味에 있어서 一切의 經濟量에 關聯되어 있다고 말할 수 있게 되고 事實 그러므로써 우리는 이른바 計量經濟學의 發展된 內容에 있어서 이 方面의 많은 成果를 볼 수도 있게 되어있는 것이다. 다만 여기에 注意를 要하는 點으로서 經濟理論의 構造에 따라서는 그의 性質이 반드시 確率論의 特象으로서 適格性を 갖지않는 것이 없지않다. 限界效用의 觀念은 그의 典型的인 것이라 할 수 있는 것이나 또한 우리는 「케인즈」의 理論* 에서와같이 確率的, 數量的인 範圍를 意識적으로 넘어있는 例도 볼 수 있는 것이다.

* 『우리들이 決定을 내리는 長期期待의 狀態라는것은 可能한 最近的 (the most probable) 豫測만에 依存한다는것이 아니다 그는 또한 우리들이 豫測을 可能케 하는 確信 (confidence)에 依存하기도 하는 것이다,』「General Theory」P 148)

지금 試驗삼아 計量經濟學의 表式을 여기에 빌려서 一般利潤率의 形成關係를 具體化하건데 첫째 商品價格 P 는 費用價格 p 와 어떠한 利潤水準 m 에 依하여 構成되는 것이 自明하므로 現實의 價格은

$$P = p + m$$

그런데 各確率變數에 關하여

$$p=c+v$$

$$m=Kv+e$$

(但, K 는 常數로서 剩餘價值率, e 는 誤差額)

이므로 따라서

$$P=c+v+Kv+e$$

e 는 이 式에서 誤差項이 되는 同時에 그는 한편 利潤率 R 와 더불어

$$R = \frac{m}{c+v} = \frac{Kv+e}{c+v}$$

로서 어떠한 制의 下에 놓여있는 變量임이 分明하다. 그러면 e , 따라서 R 은 資本의 完全競爭下에 있어서 어떠한 確率的制的(確率分布)下에 놓여있는 것인가?

正確히 數式的으로 말하면 R 의 分布는 3個의 變數 c , v 및 e 의 同時確率 分布形을 取할것으로서 內容的으로는 至極히 複雜한 構造를 갖는 다고 생각될수 있다. 그러나 여기에서는 R 을 하나의 變數로서 간단히 생각하여 그가 正規分布를 한다고 볼수 있는것이다*. 그리하여 우리는 그의 期望值(expected value) $E(R)$ 로서 하나의 特性值를 얻게된다. 이 것이야 말로 바로 우리의 意味한바 一般利潤率의 表章이매 틀림이 없는 것이다.

* 『市場價格은 이 調節的인 生産價格 以上으로 되고, 또는 그 以下로 된다. 그러나 이들 運動은 相互 均衡에 歸한다. 하나의 長期間에 걸친 價格表를 觀察하고, 또한 商品의 現實的價值가 勞動生産力의 變動에 依하여 變化할 여러 경우와 또는 自然的 또는 社會的事故에 依하여 生産行爲上에 攪亂을 일으키는 여러 경우를 除外하고 생각한다면 우리들은 우선 위의 運動이 比較的 狹小한 限界에 그쳐 있다는것, 그리고 다음에 그의 相互均衡化의 規則性에 놀라게된다. 우리들은 이 경우에있어서 「퍼레테」가 社會的諸現象을 論證한바와 같은 調節的平均의 支配를 發見하는것이다』(『資本論全上』下 P. 396)

要컨대 一般利潤率은 하나의 確率的인 期待值=平均值이므로 그것은 하나의 觀念的인 存在이다. 그러나 現實的으로는 各商品에 關하여 具體的인

利潤率 R 이 나타나 있을뿐인것이다. 그러므로 『總生産價格』 總價値와 같다.는 앞에서의 命題, 即

$$\Sigma[c+v+E(R)(c+v)] = \Sigma(c+v+Kv+e)$$

도 그러한 意味에 있어서만이 우리의 考察의 特象이 될수 있다는 關係를 認識함은 重要하다. 왜냐하면 위의 式의 左邊에는 純觀念的인 要素가 包含되어 있고, 右邊은 보다 實體的인 內容으로서 認定되기 때문이다.

三

우리는 以上에 있어서 一般利潤率의 形成關係를 靜態的으로 살펴보았으므로 이번에는 나아가서 그의 時間的 變動關係를 確率論的立場에서 考察하지 않으면 아니된다. 그럼으로써 우리의 問題의 內容은 보다 豊富하게 展開될 것이고, 또한 그로말미암아 우리는 한 거름 깊이 現實에 接近할수 있게 될것이다. (다만 時間的變動, 即 確率過程의 表現은 一般的으로 複雜性을 띠우게 된다.)

첫째 一般利潤率의 長期的 變動關係에 對하여서는 周知하는 바와같이 「低下의 傾向의 法則」이 없지않다. 그러므로 우리의 議論 또한 이러한 點을 前提로하는것이나 우리는 여기에 問題를 우선 各種利潤率의 定常的 分布에 關하여 그의 振動(oscillation)의 必然性을 論證하려하는 것이다.

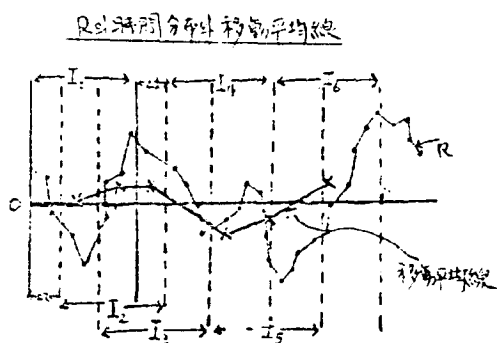
누구나 아는바와같이 自由競爭下에 있어서 諸商品의 市場價格은 時間的으로 不斷히 變動한다. (같은 時點에서 生産된 同一 商品이라 할지라도 勿論 時間的으로 그의 販賣價格은 不斷히 變動한다.) 그것은 勿論 個別的 生産部門의 利潤率의 時間的變動 따라서 社會的 一般利潤率(期望值)의 時間的變動에 그대로 照應되어 있는것이다. 그러면 우리는 偶然的要因에 依하여 不斷히 變動하는 個別的인 商品價格의 變動狀態 따라서 一般的利潤率의 變動狀態를 어떻게 如實히 表現할수 있을 것인가, — 얼른 생각하여 그것은 實地調査의 記錄으로써 容易히 紙面上에 表現할수 있을 것도 같다. 그러나 表現의 方式이 問題이다. 왜냐하면 實地調査의 記錄은 事實上의 時間的 變動値에 對한 어떠한 移動平均値(moving average)로서 認定

되고, 事實의 變動狀態는 時間的, 連續적으로 變動하고 있기 때문이다. 그러므로 우리의 理論(事實)과 實地(調查)와의 사이에는 그만큼 誤差를免치 못하는 것이 分明하지만 어쨌든 一般利潤率의 期待된 表章(觀念이라하여도 無妨함)은 위에서 본바와같이 어떠한 時間的 間隔에 있어서의 各種產業이 가진 利潤率의 平均值로서 本質적으로 振動함이 分明하다. (이 關係는 周知하는바와같이 일찍이 數理的으로 자세히 考察되어 있다. — Slutsky-Yule 效果)*. 要컨대 各產種利潤率에 關한 移動平均值로서 觀念된 一般利潤率은 各產業의 利潤率이 偶然性を 갖는 限에 있어서 必然적으로 振動狀態로 表現된다는 것이다. (그림)

* Kendall; The Advanced Theory of Statistics, Vol., II, P. 381 以下參照. 더욱 Slutsky 等の 企圖한바 經濟循環의 成立을 偶然의 小原因의 累積 移動平均으로서 說明하고자 하는 構想에 對하여 本論이 가진 다른 性質은 一般利潤率이라는 것이 偶然的利潤率의 期待值=平均值로서 처음부터 實質的意味을 갖는 計數이라는데 있다. 따라서 그의 移動平均法은 그러한 實質的意味에 있어서 制約되지않으면 아니되는 것이고, 單純한 統計處理과같이 既存의 循環變動에 마쳐서 移動平均法을 追後的으로 調節하는 것이 아니라는 것이다. 그리고 移動值算定の 模型이 같지 않다. (그림參照)

以上の 結果를 여기에 要約하면 다음과 같다. (우리는 一般利潤率을 確率의 背景에서 考察하게 됨으로써 다음과같은 몇가지 事實을 確認하게 되었다고 생각된다.) 即 (1) 一般利潤率의 形成을 價格의 形成과 同時적으로 把握할수 있게되었다는것, (2) 一

般利潤率은 元來 確率의인 期待值에 不過하므로 總生產價格=總價値의 命題는 그러한 意味에서 把握되어야 한다는것, (3) 一般利潤率은 長期的으로는 低下의 傾向을 取하되 短期的 間隔을 두어서 定常적으로 觀念될때는 (그러한 경우는 實踐的인 경우에 照應한다.) 그는 必然적으로 不規則的 波動的 變動의 性質을 갖는다는 것이다. 그리하여 만약 이 關係를 圖示한



다면 어떠한 亂數列 (各産業의 利潤率은 偶然的인 것이므로)에 있어서 하나의 移動平均系列을 얻게 될것이 期待되는 것이다. (위의 模型的그림 參照)

— 끝 —