

CHAPITRE 5. RATIONALITES INDIVIDUELLES, IRRATIONALITES COLLECTIVES

ARROW – NASH – SAMUELSON

I. La théorie de l'équilibre général

La TEG s'interroge sur le moyen d'atteindre, dans une éco décentralisée, l'intérêt général. S'inscrivent dans le prolongement de l'idée smithienne de main invisible, énoncé de manière très générale : des indus qui poursuivent chacun leur intérêt propre sont amenés à réaliser involontairement et inconsciemment l'i général.

1. L'intérêt général comme optimum de Pareto

a) Déf

Le concept d'optimalité se définit indépendamment du concept d'équilibre. Elle ne dépend que des préférences des consommateurs, même lorsqu'on considère une économie de production.

Une situation est optimale s'il est impossible d'améliorer la situation d'un agent sans détériorer celle d'aucun autre. A l'inverse, une situation est sous-optimale s'il est possible d'améliorer la situation d'au moins d'un agent sans détériorer celle de quiconque.

La définition de l'optimum de Pareto résulte de l'application d'un critère (critère de Pareto) qui permet de comparer des situations.

- Une situation est préférée à une autre selon le critère de Pareto si elle est préférée strictement par au moins un agent, et au sens large par tous. Ce critère de comparaison des situations possibles est unanimiste, i.e. requiert l'unanimité des agents. Une situation est préférée selon ce critère si les agents sont unanimes à la préférer, au sens strict ou au sens large. Une situation est optimale si, en comparant cette situation à toutes celles qui sont possibles (ou concevables), aucune ne lui est préférée selon le critère de Pareto. Notons que ce critère est incomplet : il ne permet pas trancher les comparaisons de situations lorsque le jugement des agents n'est pas unanime (voir plus bas).

- Un optimum est une situation A telle qu'aucune autre situation possible (B, C, etc.) ne lui est collectivement préférée. Une situation préférée collectivement est préférée strictement par au moins un agent et au sens large par tous les autres.

Remarque. « Améliorer » la situation d'un agent ne signifie pas ici enrichir l'agent (avec une évaluation monétaire de l'enrichissement). Dans une économie d'échange par exemple (ce qui simplifie le raisonnement sans le modifier), quelle que soit la situation considérée (optimale ou sous-optimale), il est impossible d'enrichir un agent sans en appauvrir un autre. Mais il est possible

d'améliorer la situation d'un agent en termes non de richesse (richesse sociale objective, monétairement mesurée) mais d'utilité ou de préférence (évaluation subjective propre à chacun). La caractérisation de l'optimalité parétienne dépend des seules préférences, que l'on peut exprimer par une fonction d'utilité (utilité ordinale). Alors, il existe des situations sous-optimales, i.e. telles qu'on peut améliorer la situation d'au moins un agent sans détériorer celle de quiconque.

Irrationalité collective des sous-optimalités

b) Optimalité et conflits de répartition

Il est fréquent (mais pas systématique) que la comparaison entre deux situations soit impossible. C'est le cas dès que le jugement d'un agent au moins, à propos de cette comparaison diffère strictement de celui des autres.

Exemple. Dans une économie d'échange composée de plusieurs agents (au moins deux), on considère une répartition (notée A) très inégalitaire des ressources : un agent possède toutes les ressources. La répartition A est Pareto-optimale : il est impossible d'améliorer la situation de quiconque sans ôter à l'unique détenteur de toutes les richesses une part de sa richesse, et donc sans détériorer sa situation.

Une répartition (notée B) égalitaire, dans laquelle chacun possède les mêmes ressources (la même quantité de chaque bien), est sous-optimale si les goûts des agents diffèrent (cf. l'exemple précédent des fumeurs et non-fumeurs).

La quasi-totalité des agents préfère la répartition B à la répartition A. Mais il n'y a pas de classement parétien entre ces deux situations du fait de l'absence d'unanimité des jugements des agents sur la comparaison entre les deux situations. En comparant A et B, les jugements des agents diffèrent et révèlent un conflit dans la répartition des ressources que le critère parétien ne saurait trancher : ces deux distributions sont incomparables selon ce critère. Il reste que celle qui est sous-optimale implique un gaspillage des ressources regrettable : il serait collectivement préférable que les ressources de chacun soient ajustées à ses goûts.

Cet exemple montre également que l'optimalité peut s'accompagner de la plus grande inégalité dans la distribution des richesses. L'optimalité n'exprime rien sur la justice d'une répartition des ressources. C'est d'ailleurs la raison pour laquelle Arrow et Hahn choisissent « le terme "Pareto efficace" au lieu du plus répandu "Pareto optimal", qui pour eux véhicule plus de contenu prescriptif que le concept ne devrait en comporter, « puisque une allocation Pareto efficace peut attribuer de très faibles utilités à certains ménages et donc n'être optimale en aucun sens qui inclut l'éthique distributionnelle » [Arrow et Hahn, 1971, p. 91]. En conséquence, un optimum de Pareto particulier n'est pas toujours souhaitable. L'optimalité parétienne ne suffit pas à élire ou à justifier une allocation des ressources.

Cette indifférence de l'optimalité parétienne à la justice de la répartition des ressources milite pour l'introduction d'un critère de justice supplémentaire. Mais elle n'invalide pas le critère parétien.

D'abord parce que l'optimalité reste souhaitable même si elle n'est pas la justice.

Ensuite parce que l'indépendance entre optimalité et justice certes souligne les limites de l'optimalité mais atteste aussi de sa généralité : s'il existe diverses conceptions de la justice, l'optimum de Pareto, puisqu'il n'est lié à aucune, est possiblement compatible avec toutes.

Plus encore, le fait qu'il existe une infinité d'optima de Pareto, incomparables entre eux, suggère qu'on peut introduire des considérations de justice qui feront élire, parmi les optima, celui qui est le plus conforme à la justice. Tenir compte de la justice n'invalide pas le raisonnement parétien : il en souligne seulement le caractère incomplet, puisque le critère ne permet pas de comparer entre eux toutes les situations possibles et que l'optimalité ne permet pas d'élire un état unique parmi tous les autres.

L'existence de conflits de répartition ne doit pas faire négliger la possibilité de situations sous-optimales. L'atteinte d'une situation optimale comme zone d'intérêt convergents/l'indétermination de l'optimum parmi une infinité.

2. L'équilibre concurrentiel

a) Question de la coordination : des décisions cohérentes (= coordonnées = ajustées aux besoins des agents et aux ressources initiales de l'économie)

Toutes les sociétés, quel que soit le type d'institution qui les gouverne, rencontrent un problème économique commun : celui de la cohérence des décisions économiques. Une société qui systématiquement produit des décisions incohérentes ne peut pas fonctionner économiquement.

Produire trop de biens de production relativement aux ressources et aux besoins de consommation, entraîne le risque que la production des biens de consommation ne permette pas d'assurer la subsistance de la population, ce qui ne serait pas viable très longtemps. Mais ne produire que des biens de consommation sans s'inquiéter de l'usure et du remplacement des biens de production ne l'est pas non plus, car met en péril la survie future de la société. La production d'une marchandise systématiquement excessive ou insuffisante par rapport aux besoins est une incohérence économique.

En particulier, les situations dans lesquelles la production est inférieure aux besoins ne sont tout simplement pas réalisables. La survie économique d'une telle société est menacée. Les situations de production excessive par rapport aux besoins peuvent avoir lieu mais cela constitue un gaspillage social des ressources.

Remarque. Beaucoup de situations de crise peuvent être comprises comme le résultat de décisions économiques incohérentes. En voici trois exemples.

Exple 1. La chute de l'URSS n'est pas seulement une question politique (aspiration aux libertés) mais aussi une question économique : le privilège accordé à la production des biens de production (le programme militaire et spatial par exemple) a nui aux besoins de consommation de la population. La production y était incohérente au regard des besoins de la population.

Exple 2. La crise économique mondiale des années 1930 et en particulier le chômage massif révèle une incohérence des décisions : alors même que des agents souhaitaient travailler pour satisfaire leurs besoins de consommation (à moins de supposer qu'ils sont chômeurs volontaires), ils en étaient empêchés, ce qui constituait un gaspillage des ressources : le travail qu'ils auraient pu fournir aurait satisfait leurs besoins, le chômage gaspille le temps qui s'écoule en pure perte : les chômeurs ne jouissent pas de ce temps comme d'un temps de loisir (à moins d'être chômeurs volontaires) ; ils ne l'emploient pas pour produire les biens dont ils ont pourtant besoin ; ils ne peuvent pas l'« épargner » pour l'utiliser à la période suivante.

Exple 3. La crise climatique peut être conçue comme une situation dans laquelle nos décisions sont incohérentes au regard de nos besoins futurs, puisque nos décisions de production et de consommation menacent notre survie.

b) économie décentralisée

La théorie économique depuis son origine pose la question de la coordination (comment les décisions économiques d'une société peuvent-elles être cohérentes, i.e. coordonnées, i.e. adaptées aux ressources disponibles et aux besoins ?) en considérant un type particulier et extrême d'organisation économique, dans laquelle les décisions sont prises par des centres de décisions qui sont les plus nombreux possible. À la limite, chaque individu peut y être un centre de décision.

Plus encore, ces centres décident de manière isolée, indépendamment les uns des autres. Une telle économie est dite décentralisée parce que les décisions n'y sont pas prises par un centre de décision unique qui vérifie la cohérence des décisions avant de les exécuter. Les décisions, à l'inverse, sont prises par plusieurs centres de décisions qui ne se coordonnent pas entre eux, c'est-à-dire qui décident indépendamment les uns des autres. Cette économie décentralisée peut être comprise comme une idéalisation de la société marchande, dans laquelle une multiplicité d'agents prennent des décisions indépendamment les uns des autres. Les producteurs produisent sans commande de la part des consommateurs. Les consommateurs demandent sans vérifier que leurs demandes sont compatibles avec les ressources disponibles de l'économie et les besoins des autres consommateurs.

c) Hyp de l'éq ctuel

« La majeure partie de cet ouvrage traite de l'analyse d'une économie décentralisée idéalisée. En particulier, on supposera, la plupart du temps, qu'il y a concurrence parfaite et que les choix des agents économiques peuvent être déduits de certains axiomes de rationalité. Ce n'est que récemment qu'un examen relativement complet et rigoureux de cette construction a été possible »

(A et H)

Agents maximisateurs d'U ou de profit, le contenu des fcts d'U peut être libre mais certains résultats exigent fcts autocentrées. Décisions d'O et D

Concurrence : agents price-takers. Decisions prises à partir des prix, des objectifs et des contraintes.

Equilibre : excc d'un syst de prix qui égalisent O et D sur chaque marché.

d) Les prix permettent une coordination sans instance coordinatrice :

Dans la TEG, les prix sont le moyen de la coordination : c'est à travers les prix que les décisions économiques entrent en relation, de manière indirecte, les unes avec les autres. Ce sont, pour les économistes, les prix qui permettent la cohérence de décisions indépendantes et non coordonnées intentionnellement. C'est pourquoi la théorie des prix – c'est-à-dire ici la théorie de la valeur, parce que les prix dans l'approche de l'équilibre général sont appréhendés indépendamment de leur expression monétaire – n'est pas un élément parmi d'autres de la théorie économique : elle est l'élément qui structure tous les autres. Les concepts économiques ne peuvent être pensés en dehors de la théorie des prix, parce que ce sont les prix qui assurent la cohérence des décisions c'est-à-dire, in fine, la possibilité d'une économie décentralisée. C'est à partir des prix que l'on définit les décisions des agents dans le modèle et que l'on assure leur coordination.

Les prix sont supposés être déterminés par un mécanisme, c'est-à-dire en dehors de toute volonté, individuelle ou collective. La cohérence des décisions économiques, si elle est permise par le mécanisme est prix, est donc assurée en dépit de l'absence de toute volonté de coordination. Elle ne résulte pas d'une volonté individuelle puisque les agents, lorsqu'ils décident, ne cherchent pas à ce que leurs décisions soient compatibles (= cohérentes) avec celles des autres : les producteurs n'agissent pas dans le but de satisfaire les besoins des consommateurs ; les consommateurs n'agissent pas non plus dans le but de fournir un débouché aux producteurs (comme dans ces tombolas où l'on achète un billet pour encourager les organisateurs) ou dans le but de permettre aux autres consommateurs de satisfaire leurs besoins (en renonçant par exemple à des demandes qui leur sont accessibles, i.e. respectent leur contrainte budgétaire, pour ne pas utiliser des ressources dont d'autres peuvent avoir besoin).

e) Remarque sur l'Etat :

Aucune volonté collective, comme celle qu'incarne l'État, ne prend en charge la tâche de coordonner les décisions. L'État, lorsqu'il est introduit dans la TEG, ne prend pas les décisions à la place des agents ni n'exige que les agents vérifient son approbation avant d'exécuter leurs décisions.

Cela ne signifie ni que l'économie ici représentée soit une économie nécessairement sans État. L'Etat peut intervenir. Mais même dans ce cas, l'Etat ne se donne pas pour tâche de vérifier la cohérence des décisions avant d'autoriser leur exécution. La coordination des décisions

économiques n'est garantie ni par les volontés individuelles ni par une volonté collective incarnée par l'État.

3. Le premier théorème du bien-être

a) *Toute cohérence n'est pas optimalité (exce et bien-être)*

b) *La relation entre EG et OP*

Le premier théorème de l'éco du bien-être (1951) : sous certaines hypothèses (non-saturation des besoins = non-satiété ; système complet de marché = 1 prix par bien économique), tout équilibre général ctiel est un optimum de Pareto, i.e. une situation où on ne peut pas améliorer de manière évidente la satisfaction des agents.

Deux types de recherches : Lorsque l'OP est injuste : quel traitement de la justice ? et...

c) *La robustesse de la propriété d'optimalité*

La méthode consiste à s'interroger sur les conséquences d'une modification des hypothèses sur le résultat d'optimalité de l'équilibre.

« Subsiste-t-il à un changement d'hypothèses d'une économie concurrentielle à une économie de concurrence imparfaite ? Sera-t-il renversé par des externalités, par d'apparentes irrationalités – comme le fait de juger la qualité par le prix –, par le manque de marchés à terme, ou le rôle particulier tenu par le moyen d'échange ? » [Arrow et Hahn, 1971, p. vii].

Loin d'affirmer que l'économie marchande conduit toujours à un équilibre optimal, les théoriciens de l'équilibre général suggèrent au contraire que des modifications d'hypothèses peuvent remettre en cause l'optimalité de l'équilibre.

« La théorie économique moderne a graduellement raffiné les conditions sous lesquelles le système de prix peut ne pas conduire à une allocation des ressources efficace ou optimale. La plupart des discussions ont tourné [...] autour de concepts – externalités, biens publics, rendements d'échelle croissants [...] – qui permettent de cerner, entre autres, l'insuffisance ou les limites de la validité théorique du système des prix lorsque certaines actions, bien qu'elles puissent conduire à un avantage privé, peuvent se conclure par un coût social net » [Arrow, 1985, p. 64].

Dans tous ces cas, les actions individuelles décidées sur la base des intérêts privés ne permettent pas la réalisation de l'intérêt collectif. C'est pourquoi la théorie de l'équilibre général s'est développée en modifiant les hypothèses du modèle d'équilibre général concurrentiel, et en étudiant les conséquences de ces modifications sur les propriétés de l'équilibre. Il ne faut donc pas attribuer à la TEG l'idée selon laquelle l'équilibre économique, même concurrentiel, est toujours optimal. La TEG affirme seulement être en mesure d'établir les conditions de validité de cette idée et, à l'inverse, les raisons des inefficiences (= sous-optimalités) de la coordination marchande : les hypothèses qui permettent d'établir l'optimalité indiquent, en creux, les raisons pour lesquelles

l'équilibre pourrait bien n'être pas optimal, et donc les motifs de douter du caractère souhaitable de l'équilibre concurrentiel.

L'enjeu du modèle de concurrence parfaite n'est donc pas de justifier systématiquement l'intuition selon laquelle la coordination par les prix conduit à une situation collectivement souhaitable. L'enjeu est d'établir les conditions dans lesquelles cette intuition est fondée, sans préjuger de leur validité empirique, et d'étudier les conditions dans lesquelles cette intuition n'est pas fondée.

D'où externalités et biens publics (II)