

Chapitre 3. Economie et politique

I. Introduction

II. TEG et libéralisme économique

III. Economie et transformation sociale : la plasticité des résultats théoriques

Le second sens du libéralisme : la société doit se comprendre à partir des individus qui la composent et chacun doit y être libre de définir et de poursuivre son intérêt personnel. Légitimité des comportements animés par la recherche de l'intérêt personnel.

Max U : chaque agent doit pouvoir poursuivre sa conception propre de la vie bonne. Il s'agit là d'un libéralisme éthique qui soutient qu'une société ne doit pas être fondée sur une conception préalable de la vie bonne. Peut concerner différentes formes d'organisation sociale des activités éco.

Max profit : s'applique dans une organisation singulière, marchande capitaliste. La max^o de l'utilité, pour chacun, et l'OP, sont des objectifs. La Max du profit n'est qu'un moyen.

1^{er} théorème du bien-être : la maximisation (utilité et profit) n'est pas incompatible avec le bien-être collectif, si elle s'exerce dans les conditions concurrentielles, et sous réserve des hypothèses énoncées par le 1^{er} théorème. Comment interpréter ces conditions ?

1. Qu'est-ce que la concurrence parfaite ?

i) Une hypothèse comportementale

A la question de savoir si des décisions guidées par les prix permettent de parvenir à une situation optimale, les théorèmes d'existence et d'optimalité de l'équilibre concurrentiel ne donnent qu'une réponse incomplète. Ils énoncent (sous les hypothèses adoptées) que si les prix sont des prix d'équilibre concurrentiels, alors les décisions prises sont cohérentes et optimales. Mais aucun des deux théorèmes n'explique comment on parvient à ces prix. On suppose que les prix d'équilibre concurrentiels sont atteints. Mais la concurrence, dans les théorèmes d'existence et d'optimalité, ne caractérise que le comportement des agents, supposés price-takers.

L'hypothèse de *price-taking* est adoptée sans justification démontrée par Arrow et Debreu. On suppose que les agents se comportent en *price-takers*. Cela signifie que chaque agent (consommateur ou producteur) prend des décisions (offres et demandes) en supposant d'une

part qu'elles sont sans effet sur les prix (i.e. par exemple que diminuer son offre d'un bien n'augmente pas le prix), et d'autre part que ses offres et demandes seront satisfaites. Il est fréquent qu'on justifie l'hypothèse de *price-taking* par l'idée d'atomicité : les agents sont infiniment nombreux (chacun est tout petit, comme un atome dans l'univers, comme une goutte d'eau dans l'océan) de sorte qu'il est très raisonnable que chacun considère que ses décisions sont sans effet sur les prix, car les prix ne dépendent que des offres et demandes agrégées. Si l'on suppose que chaque offre ou demande individuelle est négligeable au regard des offres et demandes agrégées, dont dépendent les prix, alors il serait raisonnable que chacun suppose que ses offres et demandes individuelles sont sans effet sur les prix.

Cette justification intuitive du *price-taking*, qui n'est pas présente chez Arrow-Debreu, pose de multiples problèmes (micro S4). Des désaccords persistent pour savoir quelles sont les conditions qui justifient rationnellement le *price-taking*.

ii) *La représentation d'un processus*

Mais la concurrence désigne également dans la TEG (comme d'ailleurs dans d'autres théories économiques) une autre idée : elle représente un **processus** par lequel on parvient aux prix d'équilibre. C'est cette idée qui apparaissait dans le chapitre 1 : la concurrence résume les conditions dans lesquelles les prix, lorsqu'ils ne sont pas d'équilibre, varient, selon la loi dite de l'offre et de la demande. L'intuition des économistes (pas seulement dans la TEG) est que cette loi de variation des prix conduit effectivement à l'équilibre.

La question se pose de savoir si cette intuition est logiquement fondée. C'est la question de la stabilité de l'équilibre. Le terme de stabilité ne s'entend pas au sens courant : au sens courant, une situation est stable si on y reste. Or si on est à l'équilibre, l'offre globale est égale à la demande globale sur chaque marché. Les prix qui varient selon la loi de l'offre et de la demande ne varient pas. Donc si on est à l'équilibre, on y reste. Le terme de stabilité doit s'entendre de la manière suivante : si on n'est pas à l'équilibre, la variation des prix selon la loi de l'offre et de la demande conduit-elle à l'équilibre ?

On comprend mieux la question de la stabilité par analogie avec la physique. Il existe trois types d'équilibres : une bille au fond d'un bol ; une bille au sommet d'une montagne ; une bille au col d'une montagne (le col est le point le plus élevé par rapport à deux vallées mais le plus bas par rapport à deux sommets). Chaque équilibre est stable au sens courant : si on y est, on y reste. Mais chacun n'est pas stable au sens scientifique : si l'on écarte la bille du fond du bol, elle y revient, donc le fond du bol est un équilibre stable ; si on écarte la bille du sommet de la montagne, elle n'y revient jamais, le sommet est un équilibre instable ; si on écarte la bille du col, elle y revient si on l'a placée sur un point plus élevé (en allant vers un sommet), elle s'en écarte si on l'a placée sur un point moins élevé (en allant vers une vallée), l'équilibre est stable ou instable selon les déviations envisagées.

La question de la stabilité en économie est la suivante : si l'on est hors de l'équilibre, la variation des prix selon la loi de l'offre et de la demande ramène-t-elle à l'équilibre ? Si la réponse est positive, l'équilibre est stable.

Le traitement de cette question a fait l'objet de travaux difficiles et la réponse théorique est négative. On ignore les conditions qui pourraient garantir que l'équilibre est stable. Plus précisément : on est incapable d'établir des hypothèses semblables à celles des théorèmes d'existence et du bien-être (hypothèses qui portent sur les caractéristiques des agents et l'organisation des marchés) qui garantissent la stabilité de l'équilibre. Ce résultat négatif est l'une des raisons pour lesquelles les économistes ont progressivement abandonné le champ de recherche de la TEG. L'une des difficultés de ce changement est que l'on suppose généralement (même dans les travaux qui s'écartent de la TEG) que l'équilibre est atteint, sans qu'on sache comment il l'est.

iii) Le commissaire-priseur

Si tous les agents sont price-takers, un agent fictif doit avoir pour rôle de fixer des prix. Comment s'interprète l'hypothèse du commissaire-priseur ?

- Marchés d'enchères :

Marchés singuliers et rares dont le fonctionnement n'est pas toujours semblable au tâtonnement.

- Un vide logique (Arrow 1959, Hahn 1987)

Pour Arrow, cet agent fictif répond à la nécessité de combler un « vide logique dans les formulations habituelles de la théorie d'une économie parfaitement concurrentielle, lequel est qu'il n'y a pas de place pour une décision rationnelle sur les prix comme il y en a pour les décisions sur les quantités » [Arrow, 1959, p. 41].

Ce vide logique est, pour Arrow, l'indice d'une insuffisance du modèle : la loi de l'offre et de la demande n'est pas au même niveau logique que les hypothèses qui sous-tendent les équations exprimant les offres et les demandes comme des fonctions des prix. La théorie est incapable de dire de qui émane la décision de modifier les prix suivant la loi dite de l'offre et de la demande : « chaque participant à l'économie est supposé prendre les prix comme donnés et déterminer ses choix comme des achats et des ventes selon ces prix ; il ne reste personne dont la tâche serait de décider des prix » [Arrow, 1959, p. 43]. Cette critique d'Arrow est reprise par Hahn, pour qui « le commissaire-priseur fictif est la conséquence d'une lacune théorique et, de fait, d'une difficulté logique » [Hahn, 2008]. Les décisions sur les prix ne résultent d'aucune rationalité individuelle ni collective.

- Mécanisme de marché ou planification

Le mouvement des prix ne s'explique par aucune volonté. Soit par concurrence, soit par « socialisme de marché ».

2. Le socialisme de marché

En effet, Lange pensait que le modèle walrassien décrivait une économie capitaliste, concurrentielle et décentralisée et pouvait aussi bien décrire une économie socialiste, concurrentielle et décentralisée. Cela indique une universalité de la TEG.

Dans un article publié en 1920 puis traduit de l'allemand sous le titre « Economic Calculation in the Socialist Common Wealth » en 1935, Mises affirmait que l'allocation rationnelle des ressources dans une économie socialiste était une impossibilité théorique (1935, [1920], p. 104). Il dira, dans une phrase restée célèbre, que « le socialisme est l'abolition de l'économie rationnelle » (Ibid., p. 110 ; cf. Ibid, p. 92). Le socialisme se caractérise par la double abolition du droit de propriété privée (propriété publique) et du marché (planification). Or sans droit de propriété privée sur les moyens de production, il ne peut exister de marché pour les moyens de production, donc de prix des moyens de production, donc d'évaluation rationnel de leur usage : « là où il n'y a pas de marché concurrentiel, il n'y a pas de mécanisme de fixation des prix ; sans mécanisme de fixation des prix, il n'y a pas de calcul économique » (Mises, 1935, [1920], p. 111). Il est donc impossible d'allouer rationnellement les ressources dans une économie socialiste.

L'objection de Mises était dirigée contre les socialistes du début du XIXème siècle qui plaidaient en faveur d'une économie planifiée et centralisée, qui fonctionnerait sans les catégories économiques capitalistes.

Lange propose un modèle de socialisme décentralisé = marché concurrentiel sans la propriété privée des moyens de production. *On the Economic Theory of Socialism* (1964, [1938]). Modèle de marché sans propriétaires du capital, qui mobilise les prix comme instrument de la décentralisation des prix. Hypothèses :

- Marché (réel) pour les services du travail (liberté dans le choix du travail) qui détermine le prix de marché des salaires.
- Marché (réel) pour les biens de consommation (liberté dans les choix de consommation) qui détermine le prix de marché des biens de consommation.
- Les biens capitaux sont publiquement appropriés, contrôlés par l'Etat.
- Les profits des firmes (intérêts, rentes, profit pur) sont socialisés et redistribués aux agents sous la forme de biens publics (consommation commune), d'investissement public dans le stock de capital (accumulation du capital) et d'un dividende social.
- Le management économique est séparé de l'appareil politique de l'Etat. Les firmes sont dirigées par des fonctionnaires soumis à un contrôle organisé démocratiquement.

- Il n'existe pas de marché réel pour les biens capitaux) mais un pseudo-marché simulé par un bureau de planification qui détermine les prix comptables des biens capitaux. Le bureau de planification alloue les biens capitaux et décide de leur accroissement. Il détermine pour cela les prix des biens capitaux, par une méthode d'essais-erreurs identique au tâtonnement : « [supposons] que le Central Planning Board commence avec un ensemble donné de prix choisis au hasard. Toutes les décisions des managers de la production et des ressources productives publiquement appropriées ainsi que toutes les décisions des individus en tant que consommateurs et travailleurs [suppliers of labor] sont prises sur la base de ces prix. En conséquence de ces décisions, la quantité offerte et demandée de chaque bien est déterminée. Si la quantité demandée d'un bien n'est pas égale à la quantité offerte, le prix de ce bien doit être modifié. Il doit être augmenté si la demande est supérieure à l'offre et diminué si c'est l'inverse. Ainsi, le Central Planning Board fixe une nouvelle série de prix qui sert de base à de nouvelles décisions, et qui aboutit à une nouvelle série de quantités demandées et offertes. Grâce à ce processus d'essais et d'erreurs, les prix d'équilibre sont finalement déterminés » (Lange, 1964, [1938], p. 85-86)
« [I]es prix d'équilibre sont simplement trouvés en observant les quantités demandées et les quantités offertes et en augmentant le prix d'un bien ou d'un service chaque fois qu'il y a un excès de la demande par rapport à l'offre et en le baissant chaque fois que c'est l'inverse, jusqu'à ce que, par essai et erreur, on trouve le prix auquel l'offre et la demande sont équilibrées » (Lange, 1964, [1938], p. 89).
C'est un socialisme décentralisé : en socialisme centralisé, les dirigeants des firmes reçoivent des instructions sur les combinaisons d'inputs et la production d'output. Ici, ils déterminent inputs et outputs avec deux règles : prix = min coût moyen (si coûts fixes) et prix = coût marginal (sinon). Ces règles se substituent à la maximisation du profit qui n'est plus un objectif de la production. Elles conduisent au même résultat. L'équilibre est identique à l'équilibre concurrentiel.

Différences avec l'organisation marchande capitaliste :

- La distribution des revenus du capital, égalitaire.
- Le capitalisme réel n'est pas concurrentiel mais monopolistique : « seule une économie socialiste peut pleinement satisfaire l'affirmation de nombreux économistes concernant les avantages de la libre concurrence ».

3. Arrow, « A Cautious Case for Socialism »

(« une défense prudente du socialisme », 1978, Dissent :

<https://www.dissentmagazine.org/article/a-cautious-case-for-socialism>)

i) *Contexte politique et social*

Né en 1921, Arrow est enfant pendant la Grande Dépression. Il voit les files de chômeurs à la soupe populaire, les vagues de faillites bancaires, les tragédies personnelles des déposants, le lien inquiétant entre le chômage et la montée du nazisme. « Preuve convaincante que le système économique était un désastre.

Un gaspillage des ressources (sous-optimalité parétienne)

L'idée selon laquelle le chômage était dû aux chômeurs – paresseux ou incompetent – était risible. J'ai été impressionné non seulement par les tragédies personnelles du chômage mais aussi par l'anomalie qu'était la coexistence de besoins désespérément insatisfaits avec le fait de maintenir oisifs des ressources, des hommes et des machines qui pouvaient répondre à ces besoins. (...)

ii) Une alternative théorique et réelle : le socialisme

Alternative qui offre une organisation rationnelle, centralement coordonnée, du système économique qui

- Eviterait l'instabilité de l'économie capitaliste et le coût humain et matériel terrible du chômage. Donc assurerait l'utilisation efficace de toutes les ressources
- Eviterait Les guerres et des corruptions politiques dues à la recherche du profit
- Permettrait la liberté, par l'égalité du revenu et du pouvoir
- Encouragerait la coopération plutôt que la concurrence.

iii) La TEG

- TEG et critique du capitalisme

*La cohérence de l'économie, la manière dont les marchés et la poursuite de l'intérêt personnel peuvent atteindre un degré important de coordination sans aucun échange explicite d'information — bref, les éléments de la doctrine de la main invisible d'Adam Smith main — sont devenues des éléments importants qui **nuançaient un jugement simple sur l'inefficacité des marchés.***

- La TEG comme économie idéale

*Ma réaction immédiate fut d'interpréter la théorie économique néoclassique et en particulier l'économie du bien-être comme **exposant une économie efficace idéale plutôt qu'une économie réelle** caractérisée à la fois par un chômage massif et par des distorsions monopolistiques. Le socialisme était le moyen de réaliser le marché idéal.*

iv) Critique du socialisme réel

Un régime non démocratique

Pour moi, les procès de Moscou de 1935-1936 ont marqué un tournant dramatique, voire traumatisant. Il était clair que les anciens bolcheviks avaient été injustement condamnés, et leurs aveux ne faisaient qu'accroître l'horreur, puisqu'ils parlaient de pressions barbares. Je me disais aussi que dans le cas improbable où les accusations de trahison étaient fondées, le régime de Staline était également condamné ; car qu'est-ce qui pouvait pousser ceux qui avaient tout risqué sous les tsars pour créer ce nouveau monde à se retourner contre lui, si ce n'est le sentiment profond de sa malfeasance ? Quelle que soit l'interprétation des faits, ils ne sont pas compatibles avec l'idée que l'Union soviétique est une démocratie ou même qu'elle évolue dans cette direction. Les divergences d'opinion, même entre socialistes, ne sont pas tolérées.

Je n'ai jamais cru que l'Union soviétique était une véritable démocratie, mais son retard politique pouvait facilement s'expliquer par l'histoire et le cercle d'ennemis tout à fait authentiques qu'elle avait. Mais il apparaissait maintenant qu'à mesure que la génération élevée sous le socialisme atteignait l'âge adulte et que l'Union soviétique devenait plus forte face à ses ennemis, la répression s'intensifiait, et non pas diminuait. La véritable énormité de la tyrannie soviétique n'a été révélée qu'avec le temps. Mais de mon point de vue, le défi posé au socialisme était déjà raisonnablement clair.

Quel contrôle des décisions économiques ?

Au minimum, l'économie socialiste ne garantissait pas la démocratie et la liberté individuelle. J'avais l'idée naïve qu'en l'absence d'une classe lucrative, il n'y aurait pas de classe intéressée par le pouvoir sur les autres. Il est apparu clairement que ce point de vue n'était guère adéquat. Le problème le plus grave était la possibilité que le socialisme, en concentrant le contrôle de l'économie dans l'appareil d'État, facilite l'autoritarisme, voire le rende inévitable.

v) Le keynésianisme comme solution raisonnable

Le développement et l'application croissante de l'économie keynésienne après la guerre ont changé la nature de la discussion sur l'efficacité. L'instabilité capitaliste et la contre-attaque socialiste pouvaient être synthétisées : il semblait possible d'avoir une économie qui conserve une

*grande partie de l'impulsion et de l'initiative capitalistes et permette au gouvernement d'intervenir pour éviter au moins les pires inefficacités que sont le chômage et la sous-utilisation des autres ressources. **J'ai provisoirement accepté ce qui semble avoir fait l'objet d'un large consensus de la croissance économique de l'après-guerre.** L'État a joué un rôle actif dans le maintien de la demande effective et le traitement des nombreuses imperfections du marché révélées par l'économie du bien-être théorique – la volonté de surmonter les défaillances du marché, la lutte contre les monopoles, la réalisation d'économies d'échelle. Ces interventions devraient prendre la forme de mesures relativement impersonnelles, taxes et dépenses, plutôt que de contrôles et de réglementation directs. L'augmentation des impôts plus élevés signifiait que le gouvernement était impliqué dans la redistribution. Certains d'entre nous pensaient qu'il devait aller beaucoup plus loin.*

L'usage que fait Arrow des enseignements de la TEG fait apparaître la plasticité interprétative du modèle et de ses résultats, mais aussi l'éloignement entre une économie idéale et les formes variées d'économies réelles.

Un entretien ultérieur est paru en 1995, après l'effondrement du système soviétique :
<https://www.minneapolisfed.org/article/1995/interview-with-kenneth-arrow>