

Isabelle This Saint-Jean

Université du Littoral

Laboratoire d'économie, méthodologie et modélisation appliquée

Pôle d'histoire de l'analyse et des représentations économiques, université de Paris I

AUTORÉALISATION ET COMMUNICATION EN ÉCONOMIE

La discipline économique met au cœur de ses réflexions la prise de décision et les choix des individus. Si ces choix et ces décisions relèvent d'acteurs divers – consommateurs, firmes, État, etc. – et portent sur des objets variés – consommation, investissement, production, recherche et innovation, etc. –, le modèle central qu'utilisent les économistes pour les représenter est celui du «choix rationnel». Depuis 1952, la définition fréquemment adoptée par les économistes de leur discipline repose d'ailleurs sur ce choix rationnel, puisqu'ils retiennent la définition de L. Robbins qui voit dans l'économie «la science qui étudie le comportement humain comme une relation entre des fins et des moyens rares qui ont des usages alternatifs» (1932, p. 30). Or, un tel choix se fait sur la base d'informations. Aussi les économistes ont-ils peu à peu dirigé leur attention sur ces dernières, reconnaissant notamment que les informations pertinentes ne sont pas nécessairement données à celui qui fait un choix, qu'il peut y avoir une répartition inégale de ces informations entre les individus et donc un échange – une communication – qui génère des «coûts» pour celui qui acquiert ainsi des informations nouvelles.

Toutefois, un tournant est apparu à la fin des années 1970; un certain nombre d'économistes, pour des raisons diverses, ont en effet envisagé la possibilité que l'information qui est censée décrire et simplement «refléter» la réalité, l'engendre ou du moins la modifier. Ainsi cette «réalité» que l'on cherche à connaître serait en fait déterminée en partie par les représentations que les intervenants s'en font: leurs croyances. En particulier, les prévisions et les «représentations théoriques» des acteurs de l'économie – qu'ils forment notamment en communiquant ensemble – pourraient parfois créer une «réalité» à leur image. Les économistes retrouvèrent ainsi ce que le sociologue américain R. K. Merton avait analysé, sous la terminologie de «prophéties autoréalisatrices» (Merton, 1948, 1965)¹. La

communication d'informations n'apparaît donc plus comme un simple moyen permettant aux individus de réaliser des choix mieux «informés» (et donc plus proche du modèle de la rationalité), mais elle exercerait un effet qui va bien au-delà: elle contribuerait à modeler la réalité sur laquelle elle est censée porter. Nous allons présenter rapidement ce tournant théorique que l'on observe ainsi, à la fin des années 1970 et au cours des années 1980, au cœur de la discipline économique. Puis nous verrons que si cette dernière accepte de prendre ainsi en compte ce rôle des croyances et des représentations des individus, cela se traduit nécessairement par des conséquences épistémologiques importantes.

L'autoréalisation en économie: indétermination des modèles ou prise en compte des «facteurs psychologiques»?

Le concept d'autoréalisation occupe une place essentielle dans la théorie économique depuis les années 1970. En effet, il est au cœur de l'une des hypothèses théoriques centrales: celle dite des «anticipations rationnelles». Cette dernière, introduite dès 1961², consiste à supposer que pour former leurs prévisions (leurs «anticipations»), les agents utilisent le «modèle», la représentation théorique de l'économie, qui n'est autre que celui de l'économiste lui-même³. L'une des justifications de cette hypothèse si particulière revient à dire qu'en adopter une autre ce serait admettre que les individus se trompent de manière «systématique», ce qui serait inacceptable de la part d'individus que l'on suppose «rationnels»⁴. Il n'y aurait aucune raison de supposer ici une supériorité du modélisateur par rapport aux individus dont il étudie le comportement. À partir des années 1970, cette hypothèse est devenue couramment utilisée par les économistes.

Or la nature autoréalisatrice de ce type d'anticipations est clairement apparue dès la fin des années 1970, avec des travaux consacrés à ce que l'on appelle «la multiplicité d'équilibres d'anticipations rationnelles». Un certain nombre d'auteurs ont en effet montré que dans la plupart des modèles dynamiques⁵, dès que l'on suppose que les individus anticipent de manière «rationnelle» une variable déterminée par le modèle, ce dernier admet alors une multiplicité de solutions⁶. Cela signifie que différentes anticipations peuvent engendrer, dès lors que l'une d'elles est adoptée par les individus, une situation telle qu'elle trouve effectivement une confirmation dans les faits. Chacune de ces «anticipations rationnelles» est donc «autoréalisatrice» car elle vérifie bien les deux conditions qui caractérisent l'autoréalisation: elle est confirmée par les faits (première propriété); et c'est précisément *parce que* les individus ont adopté une telle anticipation qu'elle trouve une confirmation dans les faits (seconde propriété)⁷.

Par la suite, toute une série de travaux que l'on a coutume de désigner sous le terme de «modèles de taches solaires», apparus au début des années 1980, ont permis de comprendre que, dans les anticipations rationnelles, l'autoréalisation n'est pas seulement celle des *prévisions* des individus, mais qu'elle porte au-delà, sur les *croyances* de ces derniers qui leur ont permis de former leurs anticipations;

ce sont les «représentations» qu'ils se font de l'économie, leur «modèle» ou leur «théorie» qui s'autoréalisent⁸.

Pour le montrer les auteurs établissent ainsi une distinction entre le modèle que «le modélisateur» considère comme le «vrai modèle» (et qui pourrait effectivement trouver une confirmation dans les faits si les individus qui forment des anticipations le considéraient comme tel) et un modèle qui *a priori* paraît «absurde» (et qui va pourtant être confirmé). Ce dernier est par exemple un modèle dans lequel une variable totalement extérieure à l'économie – comme l'apparition de «taches» sur le soleil (d'où le nom de ces modèles) – influe sur cette dernière et détermine le niveau de la variable que les individus cherchent à anticiper, à savoir le niveau des prix. Les auteurs montrent alors qu'il existe une multiplicité de solutions possibles – appelées «équilibre de taches solaires» – dans lesquels la croyance *a priori* absurde des individus trouve une confirmation dans les faits: les évolutions des prix sont effectivement déterminées par l'activité du soleil. Une croyance *a priori* absurde s'autoréalise, cessant du même coup d'être absurde! La représentation ou le «modèle» que les individus considèrent comme «vrai» engendre sa propre confirmation. Du même coup, on ne peut plus définir les «anticipations rationnelles» comme le faisait Muth (1961, p. 316), à savoir comme les anticipations formées par les individus en utilisant «le vrai modèle» de l'économie. Pour former leurs anticipations, les individus utilisent, non pas le «vrai modèle» de l'économie, mais «un modèle particulier» qui engendre sa propre confirmation, par un processus d'autoréalisation. Autant de croyances, autant de solutions!

Or, la multiplicité de solutions ainsi obtenue, considérée par certains comme le signe de la *faiblesse du cadre théorique général* reposant sur les trois hypothèses théoriques centrales (à savoir celles *d'équilibre, de comportement rationnel et d'anticipations rationnelles*)⁹ est apparue au contraire à d'autres comme un argument supplémentaire en faveur de ce cadre. Les «modèles de taches solaires» ont ainsi été présentés comme des moyens d'analyser les «fluctuations» et les «cycles» des systèmes économiques; des fluctuations peuvent en effet apparaître dans ce cadre théorique, la source de ces dernières étant à rechercher uniquement dans les croyances autoréalisatrices des individus. Ces travaux permettraient donc de tenir compte du rôle déterminant des croyances et des prévisions des individus dans l'évolution réelle de l'économie¹⁰ et ce, tout en restant dans un cadre théorique parfaitement conventionnel. La multiplicité de solutions obtenue ici ne serait en réalité rien d'autre que le reflet de l'indétermination qui caractérise le monde réel; et l'inaptitude de l'hypothèse d'anticipations rationnelles à sélectionner une unique solution traduirait simplement la possibilité de voir l'économie suivre des évolutions différentes selon les croyances et les prévisions adoptées par les individus. Ces travaux gagneraient ainsi en capacité analytique et descriptive ce qu'ils perdraient par ailleurs en pouvoir prédictif.

On retrouve encore plus clairement une telle interprétation dans un autre ensemble d'analyses économiques, connues sous le terme de «modèles de bulles rationnelles», développées à la même époque¹¹. Dans ces modèles la multiplicité de solutions apparaît là encore, non comme le signe de la faiblesse des hypothèses sur lesquelles ils sont construits (anticipations rationnelles, comportement rationnel et équilibre), mais, à l'inverse, comme un moyen permettant de saisir la multiplicité des dynamiques réelles qui sont engendrées sur certains marchés par des croyances et des prévisions

autoréalisatrices. Les dynamiques de prix tout à fait particulières ayant leur source dans les croyances et les prévisions des individus – bulles spéculatives sur le prix des actifs financiers, « bulles de change » et épisodes d'hyper-inflation monétaire – trouveraient ainsi une explication dans un cadre théorique « standard », sans qu'il soit nécessaire de faire appel à une quelconque « irrationalité » des individus. L'indétermination, loin de représenter le signe d'une faiblesse théorique, constituerait au contraire la marque de la puissance du cadre théorique central des théories économiques.

Même si l'on peut douter de la validité des modèles de « bulles rationnelles » pour rendre compte des évolutions des prix sur les marchés financiers ou de celle des modèles de taches solaires pour analyser les fluctuations de l'économie¹², on peut néanmoins considérer que tous ces travaux ont contribué à rappeler aux économistes *le rôle déterminant que jouent les croyances et les représentations des intervenants dans l'évolution de l'économie*¹³. Toutefois si l'on accepte de tenir compte de ce rôle, la discipline économique doit alors admettre qu'elle fait face à toute une série de difficultés épistémologiques qu'elle partage avec toutes les sciences humaines et sociales et qui les différencient de ce que l'on appelait autrefois les « sciences de la nature ».

Des conséquences épistémologiques non négligeables

Ces difficultés découlent du fait que le discours théorique, lorsqu'il est communiqué aux acteurs, peut être pris en compte par ces derniers pour former leurs propres représentations et leurs propres prévisions. Le discours théorique peut ainsi modeler la « réalité » même qu'il est censé décrire ou prédire. « La prédiction sociale est nécessairement très difficile, écrivait le philosophe K. R. Popper, non seulement à cause de la complexité des structures sociales, mais encore à cause de la complexité particulière qui découle de l'interconnexion entre les prédictions et les événements prédits » (1957, 1988, p. 18). Cette « influence de la prédiction sur l'événement prédit (ou plus généralement [cette] influence d'un élément d'information sur la situation à laquelle se réfère l'information) », que Popper appelait les « effets Œdipe » (*Ibid.*, p. 18-19), a des conséquences épistémologiques importantes¹⁴.

Certes de tels effets Œdipe n'entraînent pas inéluctablement « l'impossibilité logique » de prévisions exactes en sciences sociales dès lors qu'elles sont rendues publiques. En effet, ainsi que Popper le souligne lui-même, les effets Œdipe recouvrent en réalité des situations très différentes : la prévision « peut, au cas extrême, écrit-il, causer même l'événement qu'elle prédit (...). Dans un autre cas extrême, la prédiction d'un événement imminent peut aboutir à son empêchement » (*Ibid.*, p. 21). Il apparaît donc clairement qu'une telle thèse n'est recevable que si l'on réduit à tort la catégorie des effets Œdipe à l'une de ses extrêmes : celle où la prévision, dès lors qu'elle est énoncée, engendre sa propre réfutation¹⁵. Or, l'effet exercé par la prévision peut à l'inverse engendrer la validation de cette dernière : elle peut être autoréalisatrice. Dans ce cas, des prévisions « publiques » exactes sont logiquement possibles¹⁶, même s'il

est vrai que le scientifique n'est pas toujours capable d'identifier une prévision autoréalisatrice¹⁷. Toutefois, quand bien même nous supposerions ce problème résolu, d'autres surgissent aussitôt.

En premier lieu, les notions même de «vérité» et de «validation empirique» se trouvent confrontées à des difficultés importantes. On ne peut plus dire en effet qu'une prévision est «vraie», ou qu'une théorie est «validée» parce qu'elle correspond à une quelconque «réalité objective»; elle est «vraie» ou «validée», simplement parce qu'elle correspond à la «réalité» qu'elle a contribué précisément à faire apparaître. Du même coup, peut-on encore vraiment parler de «vérification» ou de «validation empirique» dès lors que la prévision ou la théorie créent elles-mêmes leur propre confirmation dans les faits?

En second lieu, dans certaines situations, il existe une multiplicité de prévisions ou de théories autoréalisatrices. Différentes prévisions ou différentes théories peuvent, dès lors qu'elles sont adoptées, engendrer autant de situations dans lesquelles elles se trouvent «validées». Le critère de «vérité» ou de «validation» devient, sinon inopérant, du moins, insuffisant, pour sélectionner une unique prévision «exacte» ou une unique théorie «validée empiriquement». Ainsi la notion d'autorealisation, qui avait pu apparaître comme une solution au problème de l'impossibilité de «prévisions publiques exactes», se trouve ici, par un complet renversement, à l'origine d'un nouvel obstacle: l'indétermination liée à la multiplicité de prévisions ou de théories autoréalisatrices¹⁸.

En troisième lieu, si l'on admet l'existence des effets Œdipe, le scientifique ne peut plus être considéré comme un observateur purement «extérieur»: «le savant et son objet appartiennent au même monde» [Popper, (1957), 1988, p. 20]. Surgit du même coup la possibilité que le discours scientifique soit utilisé par celui qui le prononce afin de faire apparaître ou d'empêcher des événements particuliers en fonction de ses intérêts propres. Aussi, l'influence que peuvent exercer ses prévisions ou ses théories peut «être de nature à en altérer gravement l'objectivité» (*Ibid.*, p. 22). En réalité, même sans prêter au «scientifique» de telles intentions, dès que l'on admet l'existence d'effets Œdipe, on est alors confronté à un problème de «manipulation»¹⁹; la situation que l'on observe *in fine* dépend de la prévision ou de la théorie que le scientifique aura énoncée et ce, qu'il dise ou non la «vérité».

Ainsi, l'influence que les prévisions ou que les théories économiques sont susceptibles d'exercer sur la «réalité» même qu'elles sont censées prédire ou décrire pose-t-elle une série de problèmes épistémologiques non négligeables à notre discipline. Quelles conséquences faut-il en tirer? Notre position est qu'il y a bien là une série de difficultés *spécifiques* à l'économie – et plus généralement aux sciences sociales – qu'elles ne doivent pas négliger. Certes, on retrouve dans toutes les sciences empiriques, une interaction entre l'objet et le discours théorique, toutefois la forme qu'elle recouvre avec les effets Œdipe est propre aux sciences sociales. Pour le dire de manière un peu triviale, l'objet du discours théorique n'est pas ici inerte, purement passif, ni même simplement «réactif»; il est capable de considérations stratégiques. On retrouve ici une antienne de l'épistémologie des sciences sociales selon laquelle les individus étudiés par ces dernières sont des sujets connaissant.

Il nous semble donc que le chercheur doit s'efforcer de tenir compte de l'influence que ses propos peuvent exercer et admettre qu'il n'est pas dans un rapport d'observateur extérieur, face à ce qui serait

une réalité « objective ». Il doit intégrer une réflexion sur l'influence que ses théories et ses prévisions, lorsqu'il les « communique », sont susceptibles d'exercer sur la réalité qu'il se donne comme objet. Telle était la position développée par Pierre Bourdieu lorsqu'il écrivait : « La science sociale doit englober dans la théorie du monde social, *une théorie de l'effet de théorie* qui (la théorie) en contribuant à imposer une manière plus ou moins autorisée de voir le monde social, contribue à faire la réalité de ce monde » (P. Bourdieu, 1982, p. 100, nous soulignons). Les effets qu'exercent les prévisions et les théories ne constituent peut-être pas une objection dirimante à la scientificité empirique de l'économie, ils représentent toutefois une série de difficultés épistémologiques réelles que l'économiste ne peut pas ignorer.

NOTES

1. Il faut noter que la définition que propose Merton dans son texte séminal de 1948 se révèle profondément insatisfaisante lorsqu'on l'analyse de manière attentive. Sur la définition de l'autoréalisation, voir I. THIS SAINT-JEAN, 1994.
2. J. MUTH (1961).
3. Le texte de Muth est en réalité beaucoup plus ambigu que la présentation que nous en faisons ici.
4. Il s'agit ici de la rationalité des comportements et non pas de la rationalité des anticipations.
5. Entendez : « prenant en compte le temps ».
6. Voir notamment, C. GOURIEROUX, J.-J. LAFFONT et A. MONTFORT, 1978.
7. En fait nous simplifions un peu pour la facilité de la présentation (sur ce point, un peu complexe, voir I. THIS SAINT-JEAN, 1998).
8. Voir notamment, AZARIADIS et GUESNERIE, 1982.
9. Cette multiplicité de solutions correspond à une indétermination de ces modèles qui, il faut le souligner, en dépit d'efforts répétés, n'a jamais pu être surmontée depuis.
10. Dans la droite ligne des idées développées par l'économiste J.-M. Keynes dans un texte célèbre, le chapitre XII de la *Théorie générale*, consacré à « L'état de la prévision à long terme ». Keynes y souligne le rôle considérable que jouent les croyances des individus et il explique pourquoi ces dernières, aussi absurdes puissent-elles être parfois, déterminent l'évolution des marchés financiers.
11. Voir notamment BLANCHARD et WATSON, 1982. (Sur ces travaux, I. THIS SAINT-JEAN, 1998 et 2005).
12. Les partisans d'une lecture aussi optimiste de ces théories sont de moins en moins nombreux et peu à peu ces travaux ont occupé une place nettement plus mineure dans les revues académiques.
13. De multiples analyses théoriques se sont depuis efforcées de prendre en compte ce rôle des croyances et des représentations.
14. Sur ce point, voir I. THIS SAINT-JEAN, 1996.
15. On reconnaît ici les prévisions « autodestructrices » ou « suicides » identifiées par le logicien J. Venn et reprises en 1936 par le sociologue R. K. MERTON (1936).

16. Une telle démonstration apparaît dans E. GRUNBERG et F. MODIGLIANI (1954) et d'autre part, H. A. SIMON (1954).
17. Bien qu'il s'agisse, nous l'avons vu avec les anticipations rationnelles, de l'hypothèse usuellement adoptée en économie.
18. Difficulté qui correspond au problème théorique central de la multiplicité des «équilibres d'anticipations rationnelles» (voir *supra*).
19. GRUNBERG et MODIGLIANI, 1954, p. 471.

RÉFÉRENCES BIBLIOGRAPHIQUES

- AZARIADIS, C., GUESNERIE, R., «Prophéties créatrices et persistance des théories», *Revue économique*, 5 (sept.), 1982, p. 787-806.
- BLANCHARD, O. J., WATSON, M. W., «Bulles, Anticipations rationnelles et Marchés financiers», *Annales de l'INSEE*, 54, 1984 (1982), p. 79-101.
- BOURDIEU, P., *Ce que parler veut dire. L'économie des échanges linguistiques*, Paris, Fayard, 1982.
- GOURIEROUX, C., LAFFONT, J.-J., MONTFORT, A., «Rational Expectations in Dynamic Linear Models: Analysis of the Solutions», *Econometrica*, 50(2), 1978, p. 409-425.
- GRUNBERG, E., MODIGLIANI, F., «The Predictibility of Social Events», *Journal of Political Economy*, 62(6), 1954, p. 465-478.
- KEYNES, J.-M., *La Théorie générale de l'emploi, de l'intérêt et de la monnaie*, Paris, Petite Bibliothèque Payot, traduction française, 1971 (1936).
- MERTON, R., «The Unanticipated Consequences of Purposive Sociale Actions», *American Sociological Review*, I, 1936, p. 894-904.
- MERTON, R., «The Self-Fulfilling Prophecy», in *Éléments de théorie et de méthode sociologique*, Paris, Plon, traduction française, 1965 (1948).
- MUTH, J.-F., «Rational Expectations and the Theory of Price Movements», *Econometrica*, 29(3), 1961, p. 315-335.
- POPPER, K. R., *Misère de l'historicisme*, Paris, Presses Pocket, 1988 traduction française, 1988 (1957).
- ROBBINS, L., *An Essay on the nature and signification of economic science*, Londres, Macmillan, 1932.
- SIMON, H. A., «Bandwagon and Underdog effects and the Possibility of Election Predictions», *Public Opinion Quarterly*, 18(3), 1954, p. 245-253.
- THIS SAINT-JEAN, I., «La Construction d'un concept. Des prophéties autoréalisatrices de Merton au concept général d'autoréalisation», *Économies et Sociétés*, série *CEconomia, Histoire de la pensée*, P.E. n° 19, 4, 1994, p. 161-199.
- THIS SAINT-JEAN, I., «Problèmes épistémologiques liés à l'autoréalisation des théories et des prévisions économiques», *Revue économique*, 47 (3), mai, 1996, p. 555-565.
- THIS SAINT-JEAN, I., «Le concept d'autoréalisation: de la sociologie à l'économie», *Social Science Information*, 37 (2), juin, 1998, p. 255-273.
- THIS SAINT-JEAN, I., «Les modèles de bulles rationnelles: où l'on retrouve les esprits animaux?», in Brian, E., Grenier, J.-Y. et Walter, C. (dir.), *Pour en finir avec la valeur fondamentale*, Paris, Édition de la Maison des Sciences de l'Homme, 2006.