

ANALYSE ECONOMIQUE DE SITUATIONS HISTORIQUES

Professeur Jean-Christian Lambelet

La « Science » Economique

De Smith à Lambelet et Mihailov

Table des matières

1. <u>Introduction</u>	2
2. <u>L'évolution de l'économie</u>	2
<i>Histoire et économie</i>	2
<i>L'évolution de l'économie</i>	2
<i>Premiers affrontements, ou la recherche d'une économie plus ouverte sur l'histoire</i>	2
<i>Une coupure croissante de l'économie pure par rapport à l'histoire – les marginalistes</i>	3
<i>Un savoir économique axiomatisé : la théorie néoclassique standard contemporaine</i>	4
3. <u>L'économie, une science ? Analyse de l'économie selon Hicks</u>	4
<i>Une conception de l'économie comme boîte à outils...</i>	4
<i>Approche éclectique et plurielle</i>	5
<i>L'économie comme « discipline »</i>	5
4. <u>La loi du prix unique</u>	6
<i>L'intégration économique et l'égalisation du prix des facteurs</i>	6
<i>Le rôle de l'arbitrage</i>	7
5. <u>Econométrie</u>	7
<i>Les débuts</i>	7
<i>Pourquoi en faire une discipline à part?</i>	8
<i>Méthodologie</i>	8
6. <u>Conclusion</u>	9
7. <u>Bibliographie</u>	9

1. Introduction

Le but de notre exposé est de montrer pourquoi l'économie est une science à part entière, et que des disciplines comme l'histoire et l'économétrie lui sont indispensables. On doit utiliser l'histoire pour tester la validité et l'universalité des lois et des modèles économiques, et non se borner à faire de l'histoire de l'économie. L'économétrie quant à elle est l'outil qui permet de tester ces théories. Nous aimerions aussi expliquer comment se forme une loi économique.

2. L'évolution de l'économie

Histoire et économie

Le problème des rapports de l'économie et de l'histoire est aussi vieux que la science économique, mais il semble aujourd'hui connaître un regain d'intérêt. Pourtant, à une époque d'extrême formalisation de la théorie économique, la ré-émergence d'un tel débat peut sembler curieux. Phelps Brown a dit que si l'on n'est pas économiste sans formation mathématique, on ne l'est pas davantage sans formation historique. On remarque un écart croissant entre la technicité du traitement des problèmes économiques et l'opérationnalité des résultats obtenus.

Retournons au début de la jeune science pour suivre son évolution de Adam Smith à Lambelet & Mihailov.

L'évolution de l'économie

L'œuvre d'Adam Smith (1723-1790) apparaît à l'aube des sciences sociales modernes, alors que celles-ci n'étaient pas encore divisées en branches du savoir indépendantes. En 1776, il publie « The Wealth of Nations », où il parle de la fameuse « main invisible » et explique les bénéfices d'une forte division de travail et de l'échange.

David Ricardo (1772-1823) est à l'origine de la première modélisation économique abstraite reposant sur un domaine d'études réduit aux activités sociales de production et de distribution des richesses. Ce modèle était alors fondé sur une méthode déductive. L'œuvre de Ricardo a établi une rupture avec le passé empirique des sciences sociales et a établi un objet d'étude autonome au sein du champ social.

Le désir de richesse permet de définir un ensemble de comportements possibles et susceptibles pour fonder des hypothèses à l'analyse économique: il s'agit de dissocier de l'ensemble sociétal un noyau dur strictement économique. L'économie politique ricardienne se présente alors comme la détermination d'un ensemble de lois susceptibles d'être établies de façon hypothético-déductive. C'était le commencement de « tradition épistémologique ricardienne ».

Premiers affrontements, ou la recherche d'une économie plus ouverte sur l'histoire

Ce sont d'abord Thomas Malthus (1766-1835) et Simonde de Sisimonde (1773-1842) qui rappellent aux théoriciens « trop abstraits » la « dure leçon des faits ». Selon Malthus, l'économie politique est plus proche des sciences morales et politiques que des

mathématiques en raison de la complexité des phénomènes étudiés. Malthus insiste également sur la nécessité de tenir compte des « limites et exceptions » à apporter au corps théorique central; ce à quoi Ricardo répliquait qu'il portait son attention sur l'état permanent des choses, le long terme et laissait de côté le « temporaire et l'accidentel ». Dans un lettre que Ricardo adresse à Malthus cette diversité de perspective apparaît fortement: « ...vous avez toujours à l'esprit les effets immédiats et toujours temporaires de changement particuliers, tandis que je les mets de côté et que je me concentre toute mon attention sur l'état permanent qui doit en résulter. » (lettre du 24. janvier 1817).

Les divergences entre ces deux économistes sont représentatives d'une différence de point de vue qui a opposé historiquement les économistes. On rapprochait à Ricardo qu'il tirait de sa construction théorique qui faisait simplement abstraction des déséquilibres de courte période, des implications « aussi certaines que le principe de gravitation ».

Malthus suggérait une économie plus proche des fait historiques, expliquant aussi les crises. Sisimonde demande de confronter le système théorique à la réalité de l'expérience historique observée comme nécessité méthodologique si l'on veut éviter de produire des connaissances économiques purement abstraites qui se perdent dans « un monde imaginaire ». Selon cet auteur, l'économie politique est une science pratique, devant contribuer à l'établissement d'un optimum démo-économique dans une société plus respectueuse de chacune de ses composantes. En regard, la construction ricardienne fait trop « abstraction du temps et de l'espace ».

A ce moment le chemin futur de la science économique paraît encore incertain. Mais comme on verra par la suite, la décision venait.

Une coupure croissante de l'économie pure par rapport à l'histoire – les marginalistes

A la fin du XIX^{ème} siècle, des auteurs comme Jevons et Walras renouvellent la science économique en s'appuyant sur l'outil mathématique et critiquent le noyau dur classique en se référant, de façon unique et constante, à la mécanique rationnelle. C'est à cette époque que prit place la fameuse « querelle des méthodes ». Le contenu contemporain du programme de recherche néoclassique ne laisse plus de place à l'histoire du fait du caractère réductionniste de son approche. C'est la formulation des hypothèses fondatrices qui ne suppose aucun recours à l'observation des faits.

Ces économistes mettaient en avant la notion d'utilité marginale comme élément explicatif unique de la valeur d'échange. Ils donnaient moins de poids aux influences institutionnelles et se concentraient sur les questions d'échange et de prix. L'adaptation du comportement maximisateur comme hypothèse fondatrice du système théorique et le recours au théorème d'égalisation des rapports des utilités marginales avec le rapport des prix du marché doivent être associés au recadrage du champ économique sur une base purement mécaniciste.

Dès ce moment l'emploi des mathématiques est devenu obligatoire et renforce la caractéristique abstraite de la théorie, en mettant en évidence sa portée universelle. Selon Walras, l'économie pure est « une science physico-mathématique, elle ne doit pas craindre d'employer la méthode et le langage des mathématiques ». Ce changement donne rigueur et précision à la discipline économique. Mais de l'autre côté, son noyau dur se restreint : tout ce qui ne va pas être formalisable va se trouver exclu de son champ.

L'entière autonomie du champ économique, ainsi construit, entraîne la mise à l'écart de toute référence historique et sociale au niveau des hypothèses de base. Les marginalistes ont révolutionné l'économie en faisant jouer un rôle décisif à la représentation mécaniciste et en faisant de la mathématisation une condition de la scientificité. Ce fait est à l'origine du renforcement de la méthode hypothético-déductive et de la formalisation qui seules sont appropriées aux exigences de la mathématisation. L'histoire humaine est refoulée au nom de la scientificité, le caractère hétérogène du temps et de l'espace est ignoré.

Un savoir économique axiomatisé : la théorie néoclassique standard contemporaine

Les économistes contemporains ont développé au plus haut le caractère réductionniste de la théorie néoclassique, même en l'entendant à l'analyse de tous les problèmes sociaux. La théorisation d'une société bien spécifique, celle de la société économique, ignorant toute structure macro-sociale, entraîne une « conception minimaliste ».

La grande différence entre la théorie de l'équilibre général contemporaine et celle du siècle passé et les mécanismes des prix ont été ajoutés, maintenant les conditions de l'existence des prix d'équilibre générale sont connues. Le postulat de la rationalité individuelle fonde la méthode de l'analyse. Les élargissements de spécialisation à d'autres champs, comme à l'économie du crime ou du mariage illustrent parfaitement l'extension du champ de l'étude. Chaque fois, il s'agit d'opérer, pour chaque type de comportement humain considéré, un calcul rationnel, dans lequel des avantages sont comparés avec des coûts.

La science économique, sous sa forme néoclassique standard, n'a en aucun cas besoin de recourir à l'histoire pour construire son corpus théorique. L'histoire, par la prolifération de ses singularités, viendrait même miner la robustesse des lois économiques. Finalement, on peut constater qu'entre l'économie et l'histoire se sont plutôt la séparation et la compétition qui ont prévalu. C'est pourquoi de nouveaux dialogues entre économie et histoire semblent avantageux, et surtout, intéressants.

3. L'économie, une science ? Analyse de l'économie selon Hicks

L'économie se présente aujourd'hui comme la plus scientifique des sciences sociales. L'attribution, depuis 1969, d'un prix Nobel d'économie a valu à la discipline une certaine forme de consécration par rapport aux autres sciences de la société, sans bénéficier toutefois du statut convoité des sciences de la nature.

Une conception de l'économie comme boîte à outils...

Concepts, hypothèses fondatrices, modèles et théories ne doivent pas être considérés comme des représentations de la réalité économique elle-même, il faut les regarder comme des instruments permettant d'appréhender un domaine d'investigation afin de mieux le cerner et tenter à l'expliquer.

Les hypothèses scientifiques ne sont que des simplifications à l'aide desquelles on force la réalité à prendre une forme qui la rend théoriquement opérationnelle. Prenons par exemple l'hypothèse de la concurrence parfaite : elle est très utile, commode, bien que pas nécessairement une stipulation de la réalité économique. Les modèles permettent de mieux saisir le jeu d'un concept dans un contexte défini. S'ils sont, par construction, tout à fait

« irréalistes », leur emploi en tant qu'outil est, en revanche, entièrement justifié. Les théories sont des moyens d'investigation élaborés à des fins spécifiques : l'appréhension de certains aspects du système économique. Les théories ne sont ni vraies ni fausses car elles ne cherchent qu'à organiser un champ d'étude afin de le comprendre. Ce qui importe, pour Hicks, ce n'est pas tant « la beauté intrinsèque des théories, ni leur dimension idéologique, mais leur pouvoir explicatif ».

Ainsi, concepts, hypothèses, modèles et théories ne sont que des instruments mais ils sont d'indispensables moyens de connaissance. Hicks suit donc la tradition marshallo-keynésienne de la théorie économique considérée comme boîte à outils.

Approche éclectique et plurielle

Hicks adopte une attitude pluraliste au regard des théories. Le monde économique est un monde caractérisé par l'existence et le jeu d'une pluralité de causes. L'interprétation scientifique consiste donc à privilégier une séquence causale considérée comme fondamentale, alors que dans le monde réel elle sera liée étroitement avec beaucoup d'autres.

Une causalité complexe requiert une pluralité théorique. Finalement, on retient une théorie en fonction de la finalité poursuivie, car une théorie peut être la meilleure pour l'étude d'un problème spécifique alors que pour un autre problème elle ne l'est pas. Donc, « il n'y a pas une théorie à tous égards supérieure ». On peut tirer avantage du pluralisme théorique en raison de l'apport des théories complémentaires auxquelles on devra recourir pour traiter un problème donné.

L'économie comme « discipline »

Hicks soutient une position originale quant à la nature de l'économie politique : une discipline plus qu'une science. Il partage avec Keynes le point de vue que l'économie devait surtout avoir une influence pratique et la conception de l'économie comme appareil perceptuel et d'investigation duquel des conclusions de grande importance peuvent être obtenues de la structure logique de la théorie.

Mais pour Hicks, il faut mettre l'accent sur la compréhension plus que sur les prédictions, car les prédictions ne peuvent offrir que des « explications faibles » en raison « de la clause *ceteris paribus* ». Alors « elles ne peuvent pas être vérifiées (ou falsifiées) par confrontation avec les faits ». C'est que le savoir économique est imparfait et incertain pour deux raisons. D'abord il y a peu de faits économiques qui sont connus avec précision ; et ensuite, il y a peu de lois économiques qui peuvent être considérées comme fermement établies.

Concernant les modèles se pose le problème qu'ils doivent être construits avec un nombre restreint de variables afin de pouvoir dégager des résultats significatifs. La validité des lois économiques dépend alors de la supposition générale que les variables retenues sont les seules qui interviennent dans leur formulation. La célèbre clause « toutes choses restant égales par ailleurs » est à la base de tout raisonnement même si, dans le phénomène étudié, il y a de nombreux éléments changeants.

Evidemment, Hicks ne remet pas en cause la méthode scientifique elle-même ; c'est son application à l'économie qui la différencie partiellement de ce qu'elle est dans les sciences

dures. En bref, c'est parce que l'économie est une science « caractéristiquement imparfaite » qu'il propose de lui conférer l'économie l'appellation de discipline.

Mais si, selon Hicks, l'économie n'apparaît pas testable empiriquement la théorisation ne participe-t-elle pas d'un pur jeu intellectuel. Hicks reconnaît qu'une « bonne part de la théorie n'est faite qu'en raison de l'attraction intellectuelle qu'elle exerce ; c'est un bon jeu comme de nombreuses branches des mathématiques pures ». Les produits de la théorie économique sont intrinsèquement cognitifs ; Hicks accorde plus d'importance aux critères formels pour apprécier la théorie économique – consistance, simplicité, élégance et généralité – qu'au problème de la vraisemblance empirique éprouvée des modèles.

On peut constater que Hicks est avant tout un esprit mesuré, préférant le possible à la vérité. Pour conclure on peut se demander si en qualifiant l'économie de discipline et en se contentant d'apprécier la robustesse des conclusions au regard des hypothèses, cela ne revient pas à éviter de soumettre les théories aux tests empiriques. La théorisation économique doit-elle alors se cantonner à des structures logiques sans exigence de validation empirique ? Nous y reviendrons plus loin en parlant d'économétrie.

4. La loi du prix unique

La loi du prix unique aurait pu être intitulée loi de Smith - quand il y a prix unique, il y a marché - outil très performant pour observer le cours de l'histoire économique – la taille du marché dépend des barrières naturelles ou légales. On aurait pu l'appeler « modèle du prix unique », mais lorsqu'un modèle adhère si étroitement au réel on peut le qualifier de loi. Dans ses premières définitions, l'intégration économique était assimilée au libre-échange. Mais si par intégration on veut dire incorporation en un marché unique, avec un prix unique, il est évident que les marchés peuvent se trouver segmentés de bien d'autres façons que par des règlements officiels. Les pouvoirs publics peuvent discriminer en fonction de l'origine de l'offre et ainsi segmenter les marchés, mais la nature et l'homme peuvent aussi discriminer ; la nature par la séparation géographique des producteurs et des consommateurs potentiels, les individus par les désirs divers qu'ils ont pour les biens.

Les moyens de transport et la vitesse se sont continuellement modifiés. Elargir le marché permet une plus grande division du travail. Adam Smith distinguait le commerce ordinaire et les ventes lointaines, le premier étant étroitement circonscrit dans l'espace (sauf pour les biens de grande valeur pour lesquels il vaut la peine d'encourir des frais de transport) et les secondes utilisant le transport maritime peu onéreux. A une époque où le prix du charbon transporté par terre doublait tous les milles au sortir de la mine, le charbon n'était utilisé que près de celle-ci ou des ports dans lesquels parvenait le « charbon de mer ».

Aujourd'hui, dans une large mesure, surtout dans les petits pays, les avantages comparatifs – c'est-à-dire la division du travail – s'élaborent à l'échelle mondiale : le monde entier constitue pour les biens un marché unique, avec un seul prix.

L'intégration économique et l'égalisation du prix des facteurs

L'égalisation du prix des facteurs par le seul échange des marchandises ne peut se réaliser que dans certaines circonstances bien précises : coûts de transport minimaux, commerce libre et marchés concurrentiels. Quand ces conditions strictes sont satisfaites, un prix unique pour

chaque bien dans les deux marchés signifie un prix unique pour chaque facteur dans les deux marchés. L'intégration dans le sens d'égalisation du prix des facteurs peut alors découler, soit du mouvement des facteurs, soit de celui des bien, soit d'une combinaison des deux.

Selon Smith, pour vaste marché il faut un minimum de lois et d'ordre, assurant l'exécution des contrats conclus, l'acceptation commune de normes raisonnables et une certaine forme de monnaie internationale qui soit unité de compte, instrument d'échanges et réservoir de valeur. La loi du prix unique nous entraîne vers l'histoire monétaire et vers celle des marchés internationaux de la monnaie et des capitaux qui sont très hiérarchisés, et pour lesquels on assiste à de fortes économies d'échelles et des coûts de transport minimaux.

Le rôle de l'arbitrage

Un marché peut comporter plusieurs segments, et l'arbitrage relie ceux-ci. Aujourd'hui, le marché le plus parfait existant, sans intervention des autorités publiques, est peut-être le marché des changes où, grâce à une forte concurrence et au faible prix des communications, les coûts d'arbitrage sont si peu élevés que le marché d'une devise est mondial.

Les ratios or-argent ont pu subsister à des niveaux sensiblement différents dans les divers pays tant que les coûts de transport du métal ont été élevés. Mais le fret n'est pas la seule cause. Le coût de l'information a aussi baissé. Le monopole de l'information dont jouissaient les négociants signifiait qu'eux seuls pouvaient rechercher les différences de cours qui leur permettaient d'acheter bon marché et de vendre cher, et c'est là le moteur de la loi du prix unique. Les banquiers ont inventé les lettres de change pour remplacer les paiements en espèces à effectuer sur des places éloignées, et ils compensaient les unes contre les autres lorsque les échanges étaient équilibrés afin d'économiser des moyens de paiement.

L'arbitrage entre marchés des changes procure des profits, ce qui donne naissance à la théorie de la parité des pouvoirs d'achat, fondée sur l'idée que l'arbitrage porte sur un nombre suffisant de biens et de services pour que les niveaux de prix soient égalisés par le taux de change.

5. Econométrie

Les débuts

Le terme « économétrie » aurait été utilisé pour la première fois par Pawel Ciompa en 1910 dans un livre plutôt obscur publié en Allemagne. Pour lui, les buts de l'économétrie étaient de décrire mathématiquement des séries de données économiques et de les afficher géométriquement et graphiquement. D'autres sources disent que ce seraient Ragnar Frisch, lauréat du Prix Nobel en 1969 (« for having developed and applied dynamic models for the analysis of economic processes ») et I. Fisher qui auraient baptisé cette discipline en 1930. Pour Frisch, la vue de l'économétrie de Ciompa est trop étroite. Dans l'éditorial du premier numéro de la revue « *Econometrica* » en janvier 1933, il définit l'économétrie en termes plus généraux :

« Econometrics is by no means the same as economic statistics. Nor is it identical with what we call general economic theory, although a considerable portion of this theory has a definitely quantitative character. Nor should econometrics be

taken as synonymous (sic) with the application of mathematics to economics. Experience has shown that each of these three view-points, that of statistics, economic theory, and mathematics, is a necessary, but not by itself a sufficient, condition for a real understanding of the quantitative relations in modern economic life. It is the *unification* of all three that is powerful. And it is this unification that constitutes econometrics. »

Pourquoi en faire une discipline à part?

La définition donnée par Frisch montre pourquoi. La théorie économique fait des affirmations ou des hypothèses qui sont plutôt de nature qualitative, mais ne fournit pas de mesures numériques. L'économétrie donne du contenu empirique à la plupart des théories économiques. Le but principal des mathématiques économiques est d'exprimer les théories économiques sous forme mathématique (des équations) sans se soucier de la mesurabilité ou de la vérification empirique de la théorie. L'économétrie utilise souvent les équations fournies par les mathématiques économiques mais les met dans une forme qui les rend propres à être testées empiriquement. Les statistiques économiques quant à elles sont principalement concernées par la collecte, le traitement et la présentation de données économiques (comme le PIB, le chômage, les prix, etc.) sous la forme de graphiques et de tables. Ces données sont ensuite utilisées pour les travaux économétriques. L'économétrie a souvent besoin de méthodes spéciales différentes des statistiques mathématiques car, comme en météorologie, les données ne proviennent pas d'expériences contrôlées, et sont donc plus sujettes à des erreurs de mesure.

Méthodologie

L'économétrie travaille avec des modèles, c'est pourquoi il m'a paru important d'en donner une brève définition. Cette définition dépend de la discipline considérée, mais dans le cadre de l'économétrie, nous pouvons considérer qu'un modèle consiste en une présentation formalisée d'un phénomène sous forme d'équations dont les variables sont des grandeurs économiques, selon Bourbonnais. L'objectif du modèle est de représenter les traits les plus marquants d'une réalité qu'il cherche à styliser. Le modèle est donc une représentation schématique et partielle d'une réalité naturellement plus complexe.

En gros, la méthodologie économétrique traditionnelle est la suivante :

1. Formulation d'une théorie ou d'une hypothèse
2. Spécification du modèle mathématique de la théorie
3. Spécification du modèle économétrique de la théorie
4. Récolte des données
5. Estimation des paramètres du modèle économétrique
6. Tests d'hypothèses
7. Prédications
8. Utilisation du modèle à des fins de contrôle ou de politique économique

Les 6 premiers points représentent la démarche économétrique au sens strict, et les deux derniers, surtout le dernier, sont souvent laissés à d'autres « spécialistes » comme des politiciens. On voit que le travail de MM. Lambelet et Mihailov respecte ce schéma.

6. Conclusion

On l'a vu, l'économie est une discipline qui est formalisée et dans laquelle le savoir est construit par la méthode scientifique, ce qui lui donne la rigueur nécessaire pour en faire une science ; elle n'en reste pas moins une science sociale, qui s'intéresse à la société et au comportement des institutions et des individus qui la composent.

Il est nécessaire de prendre conscience de la méthodologie, car elle guide tout travail scientifique, mais il n'est pas bon de s'appesantir sur le sujet. Le risque est qu'on se focalise dessus au détriment de la recherche dans le domaine en question. Une citation de Henry Moore décrit assez bien le problème :

« It is a mistake for a sculptor or a painter to speak or write very often about his job. It releases tension needed for his work. By trying to express his aims with rounded-off logical exactness, he can easily become a theorist whose actual work is only a caged-in exposition of conceptions evolved in terms of logic and words. »

7. Bibliographie

- Charles P. Kindleberger, « Les Lois Economiques et l'Histoire », Economica, 1992
- Arnold Zellner, « Basic Issues in Econometrics », The University of Chicago Press, 1984
- Ernst R. Berndt, « The Practice of Econometrics, Classic and Contemporary », Addison-Wesley Publishing Company, 1990
- William E. Griffiths, R. Carter Hill, George G. Judge, « Learning and Practicing Econometrics », John Wiley & Sons, inc. ,1990
- Régis Bourbonnais, « Econométrie », Dunod, 2000
- http://members.aol.com/jjalladeauco/economie_et_histoire.htm