

Quelques repères en épistémologie des sciences économiques = tester les énoncés ou les hypothèses ?

(A partir du chapitre de Philippe MONGIN dans la nouvelle histoire de la pensée économique et du livre de BLAUG sur la méthodologie économique)

On va essayer ici de replacer les discussions sur l'économétrie dans un cadre plus large des débats sur l'épistémologie des sciences économiques. Leur naissance est contemporaine de la naissance de l'économétrie mais ils ont des racines plus anciennes, à la fin du 19^{ème} siècle, dans ce qu'on a appelé « la querelle des méthodes. » et pour laquelle je vous renvoie à la fiche que je vous distribue

1. L'apriorisme en économie

Dans les années 30, on se pose avec le livre de ROBBINS (*Essay on the nature and the significance of Economic Science*, 1932), l'ouvrage où on trouve la fameuse définition de l'économie comme la science qui étudie les formes d'allocation des ressources rares : « la science qui étudie le comportement humain comme une relation entre les fins et les moyens rares, qui ont des usages alternatifs ») d'abord la question de la définition de l'objet des sciences économiques. On verra que cette question des délimitations possibles du champ d'étude de l'économie, du champ d'application des raisonnements économiques est très lié à la doctrine dominante de l'époque qui est l'apriorisme.

L'apriorisme est une position selon laquelle l'économie doit construire ses propositions dans une logique purement déductive à partir de postulats tirés de l'expérience intérieure, de l'évidence qu'elle procure. Dans la querelle des méthodes, ces économistes sont partisans d'une méthode « compréhensive » : les sciences sociales dont fait partie l'économie ne sont pas des sciences de la nature, elles ne peuvent pas défendre le même modèle de scientificité. Parce que ces sciences traitent du comportement des hommes, elles proposent une interprétation par des acteurs humains des actions humaines, elles doivent proposer des modèles d'interprétations compréhensibles par les hommes. Il faut retenir que les tenants de l'apriorisme se classent parmi ceux qui considèrent qu'il n'existe pas une méthode unique pour toutes les sciences, ils se posent en adversaires du monisme méthodologique.

La source c'est le travail de Menger, *Untersuchung über die Methode der Sozialwissenschaften* (= recherche sur les méthodes des sciences sociales) paru en 1883 (l'année de la mort de Marx et de la naissance de Keynes et de Schumpeter) qui marque le point de départ de la querelle des méthodes dans les pays de langue allemande. Il pose que l'individualisme méthodologique associé au principe de rationalité maximisatrice, les postulats de l'économie néo-classique, sont indiscutables et nous renseignent sur l'essence même des actions dans la sphère économique. Il s'inspire ici de la *Physique* d'Aristote : une science dont les principes ne relèvent pas de l'observation et donc d'une méthode inductive mais bien des principes apriori (avant toute expérience, toute observation), qui s'imposent comme

des évidences partagées parce qu'ils sont inscrits dans l'essence même des objets qu'on étudie. Contre cette position défendue par Menger, d'autres économistes comme Schmoller, défendent la méthode historique.

Dans les années 30, le grand représentant de l'apriorisme est un économiste de l'école autrichienne, Ludwig Von MISES, dont HAYEK a été très proche avant de s'en éloigner. Selon lui, l'action humaine est rationnelle par nature. « en qualifiant un concept ou une proposition d'a priori, nous voulons dire tout d'abord que l'esprit humain ne peut pas penser la négation de ce qu'ils affirment et n'y voit qu'une absurdité ; en second lieu, que notre approche mentale de tous les problèmes considérés implique nécessairement le concept ou la proposition a priori » (1962). Il écrit aussi à propos de l'économie : « ses théories particulières ne se prêtent à aucune vérification ou infirmation empirique sur le terrain de l'expérience... **l'étalon ultime pour apprécier si une théorie est correcte est la seule raison, sans l'aide de l'expérience** ».

Il reprend à son compte la distinction entre l'explication des sciences de la nature et la compréhension des sciences sociales.

Il considère que **les axiomes en question sont à la fois indiscutables, à la façon d'un théorème, et sources de savoir sur le monde = informatifs à la façon des lois physiques. Il défend donc un apriorisme radical.**

On peut repérer quatre grands principes dans cette branche de l'école autrichienne :

- l'**individualisme méthodologique** posé comme postulat a priori, il est heuristique.
- la **méfiance qui en découle à l'égard de tous les agrégats**
- le **rejet de tout test quantitatif des prédictions de la théorie**
- l'objet de l'économie dans ces conditions est de découvrir comment les forces du marché permettent la **réalisation de l'équilibre**, bien plus que de s'intéresser aux propriétés de ce équilibre

Dans les pays de langue anglaise, les représentants de l'apriorisme sont **Lionel ROBBINS** pour les Etats-Unis et **Frank KNIGHT** pour l'Angleterre (le même que celui de la distinction entre risque et incertitude). Pour les deux auteurs, comme pour Von Mises, **il existe bien des principes qui ont un caractère de certitude fondé sur l'évidence partagée.** Par exemple, pour Robbins, il existe trois grands postulats, **« ceux-ci ont à peine besoin d'être énoncés pour qu'on les reconnaisse comme évidents ».**

- les **préférences individuelles** sont ordonnées
- il existe **plus d'un facteur de production**
- les **agents sont incertains** de leurs ressources futures

A partir de ces postulats, on peut déduire les lois de l'économie. C'est le deuxième postulat par exemple, qui permet selon Robbins de fonder la loi des rendements marginaux décroissants. (attention, après la seconde guerre mondiale, Robbins bascule dans le camp des keynésiens)

C'est en même temps un apriorisme qui laisse de la place à l'empirisme, même si cette place est subordonnée. On peut confronter les constructions théoriques au matériau empirique, dans un mouvement de va-et-vient, et constater que il existe dans le matériau empirique des résidus qui ne cadrent pas avec la construction théorique. Ces résidus ne permettent pas de réfuter la construction théorique ni le

sentiment d'évidence sur lequel elle se fonde, ils permettent simplement de préciser le domaine d'applicabilité de la construction. On en vient à délimiter le champ d'application des analyses économiques.

Dans un texte de 1941 où il discute Hutchinson, Knight écrit : « **les faits vérifiables ne sont pas véritablement l'économie...** Cette inaptitude à vérifier peut-être ou ne pas être considérée comme dommageable ; il n'en demeure pas moins que c'est la vérité ». Remarque : Knight est un des grands opposants à la théorie autrichienne du capital et s'inspire sur le plan méthodologique d'un des plus grands représentants de cette école autrichienne qui est précisément Von Mises.

2. Le positivisme méthodologique se construit en opposition avec cet apriorisme

Peu à peu à partir des années 30 contre l'apriorisme, se développe une **forme de positivisme logique**, ce qui orientera le questionnement épistémologique vers d'autres questions davantage liées à la discussion des principes qui sous-tendent l'analyse, comme les hypothèses sur la rationalité des agents ou sur la rareté des **ressources**. Ces principes sont-ils informatifs et indiscutables comme le défendent les auteurs aprioristes (Von Mises, Knight et Robbins) ? Ou indiscutables parce qu'ils cessent d'être informatifs au contraire comme le défendent les adeptes du positivisme logique comme **Hutchinson, Samuelson**, inspirés très largement par les travaux de Popper ? Peut-on et doit-on tester les énoncés produits par les économistes et/ou les hypothèses qui les fondent ? **In fine, c'est bien la question de l'empirisme et de ses formes que pose les débats méthodologiques** qui se déroulent **entre les années 30 et les années 70**.

L'ancêtre de ce mouvement c'est **HUTCHINSON**, qui publie en **1938 *The significance and basic Postulates of Economic Theory***, 4 ans après le grand livre de POPPER (*Logik des Forschung*)= « logique de la recherche ». Il s'appuie sur des travaux du cercle de Vienne, très favorables au positivisme logique.

Il introduit une distinction entre deux types d'énoncés scientifiques :

→ **les énoncés logico-mathématiques**, qui servent à déduire d'autres énoncés mais qui ne permettent pas d'affirmer quoi que ce soit sur le monde, ce ne sont pas des propositions informatives. Elles sont « tautologiques », elles n'interdisent aucun état concevable du monde, elles sont compatibles avec tous les états du monde, on ne peut donc jamais les réfuter.

→ **les énoncés factuels**, qui indiquent quelque chose à propos du monde. Ces énoncés empiriques peuvent être réfutés précisément parce qu'ils interdisent que certains états du monde se réalisent et donc soient observés.

Pour ce deuxième type d'énoncés, Hutchinson pose que pour qu'ils puissent être dits scientifiques ils doivent pouvoir être soumis à un test qui permet de les réfuter. Ces énoncés ne doivent pas seulement être vérifiables mais bien réfutables. Il exclut absolument l'idée que les jugements synthétiques qui permettent de produire des énoncés sur le monde puissent ne pas être réfutables. **On ne peut rien dire sur le monde qui ne soit pas réfutable ou alors ce n'est pas de la science, ce qui pousse le positivisme à son extrême** et qui exclut l'existence d'énoncés de nature métaphysique, qui seraient à la fois synthétiques, informatifs et en même temps irréfutables.

A l'aide cette distinction, **Hutchinson se livre à une critique très virulente de la méthodologie économique en vigueur à son époque et donc de l'apriorisme des néo-classiques**. Il entend montrer que la plupart des énoncés de la science économique sont de pures tautologies, des relations entre des définitions qu'on se donne a priori. Il prend l'exemple de l'équation quantitative $MV = PT$. **La plupart des énoncés sont d'ailleurs formulés avec la clause ceteris paribus (toutes choses égales par ailleurs) ce qui en fait de purs énoncés analytiques** : en énonçant que « toutes choses égales par ailleurs lorsque le prix d'un bien augmente la demande de ce bien diminue » on ne fait que traduire ce que signifie la fonction de demande, telle qu'on l'a définie, on ne fait que déployer la définition. **Tant qu'on ne spécifie pas les clauses du ceteris paribus (les choses qu'on considère comme égales), les affirmations ceteris paribus restent des tautologies.**

Il plaide pour une science économique qui se préoccuperait de formuler des régularités empiriques, qu'on pourrait réfuter grâce à des tests ; comme la loi de Pareto sur la répartition ou bien la loi de Gresham selon laquelle « la mauvaise monnaie chasse la bonne » dans un système où n'existe pas d'unification monétaire, les agents préfèrent détenir de la bonne monnaie cherche à régler leurs échanges avec de la monnaie qu'ils jugent de moins bonne qualité (qui joue moins bien son rôle d'instrument de réserve.)

Avec cette partition binaire en deux types seulement d'énoncés qui fonde un ultra-empirisme ou un empirisme radical, **Hutchinson ignore la distinction entre de pures tautologies et des énoncés synthétiques, qui traitent du monde réel et sont en ce sens empiriques, sans pour autant être falsifiables**, c'est le cas de nombreuses propositions en économie qu'on peut qualifier de propositions métaphysiques qui constitue le socle de nombreux travaux.

Par exemple l'affirmation selon laquelle le système de prix permet d'épuiser les échanges mutuellement profitables et agit dans le sens des intérêts des agents économiques en augmentant leur utilité.

Ou bien l'affirmation selon laquelle les agents économiques poursuivent leur intérêt individuel et agissent rationnellement de façon à satisfaire cet intérêt sur le modèle d'une rationalité instrumentale, maximisatrice.

C'est vrai des énoncés avec des clauses ceteris paribus non spécifiées, considérées à tort comme de pures tautologies par Hutchinson. Si on affirme « toutes choses égales par ailleurs, l'instauration d'une taxe sur le tabac va renchérir le prix des cigarettes » c'est contradictoire avec l'énoncé « toutes choses égales par ailleurs, l'instauration d'une taxe sur le tabac va diminuer le prix des cigarettes ». Les deux énoncés sont contradictoires, ce sont bien des propositions synthétiques relatives à la réalité et pourtant ces deux énoncés ne sont pas falsifiables tant que les clauses du « toutes choses égales par ailleurs ne sont pas spécifiées ».

3. Friedman et la querelle sur le réalisme des hypothèses

Il s'inscrit dans le courant positiviste et donc hostile à l'apriorisme mais **Friedman défend une position très particulière sur la réfutabilité des énoncés**. La référence c'est son chapitre intitulé « the Methodology of positive Economics » dans *Essays in positive economics* paru en 1953.

Ce qui doit pouvoir être testé ce sont les prédictions d'une théorie mais pas le caractère réaliste des hypothèses sur lesquelles elle se fonde. Ce qui valide une hypothèse, c'est la validation des prédictions qu'on peut tirer de cette hypothèse.

« Le seul test pertinent d'une hypothèse est la comparaison de ses prédictions avec l'expérience. L'hypothèse est rejetée si ses prédictions sont contredites ; on lui accorde une confiance d'autant plus grande qu'elle a surmonté de nombreuses occasions de contradiction. **L'évidence factuelle ne peut jamais démontrer une hypothèse ; elle ne peut qu'échouer à l'infirmar, c'est ce que l'on entend quand on dit, avec quelque inexactitude, que l'hypothèse a été « confirmée » par l'expérience** ». (Friedman, 1953).

Mieux, les hypothèses, pour être heuristiques, doivent être irréalistes. Irréalistes dans le sens où elles proposent un modèle nécessairement simplifié de la réalité, elles n'ont pas vocation à être informative au sens platement empiriste du terme. « Pour être importante, une hypothèse doit être fausse du point de vue descriptif dans ses postulats. » (Friedman, 1953)

On peut comprendre irréaliste de deux façons ici :

→ **irréaliste d'abord au sens de « abstrait »** : un modèle abstrait de la réalité est nécessairement inexact sur le plan descriptif parce qu'il laisse certains aspects du réel de côté pour se concentrer sur d'autres. C'est cette abstraction qui rend aussi le modèle intéressant, on explique d'une façon simple une réalité qui est nécessairement complexe

→ **irréaliste au sens où les hypothèses sur les comportements ne paraîtraient pas correspondre à la compréhension que s'en donnent les acteurs eux-mêmes**, où du coup ces hypothèses n'obéiraient pas au principe d'une démarche compréhensive. Là aussi Friedman revendique cette dimension de l'irréalisme : ce qui importe c'est que les agents se comportent comme s'ils cherchaient à maximiser le profit et disposaient de toutes les données pour pouvoir le faire et que grâce à cette hypothèse on puisse rendre compte de leurs pratiques de façon cohérente. Ça n'est pas de savoir si réellement ils sont en situation d'adopter un comportement maximisatrice de type rationalité omnisciente. Les théories ne sont que des instruments pour comprendre le réel, c'est à cette aune qu'elles doivent être jugées pertinentes ou pas : **Friedman adopte clairement une posture instrumentaliste.**

Il faut comprendre les positions défendues par Friedman dans leur contexte : il s'agit bien de **défendre les analyses néoclassiques contre les critiques qui portent précisément sur les hypothèses comportementales qui la fondent.**