



La rationalité simonienne : interprétations et enjeux épistémologiques

Sophie Béjean, Fabienne Midy, Christine Peyron

► To cite this version:

Sophie Béjean, Fabienne Midy, Christine Peyron. La rationalité simonienne : interprétations et enjeux épistémologiques. [Rapport de recherche] Laboratoire d'analyse et de techniques économiques(LATEC). 1999, 26 p., ref. bib. : 2 p. 1/2. <hal-01526495>

HAL Id: hal-01526495

<https://hal.science/hal-01526495v1>

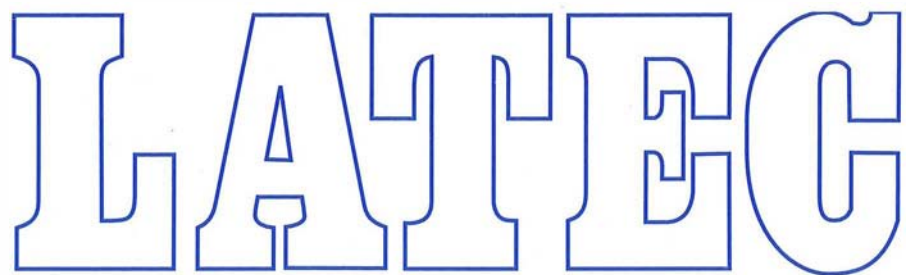
Submitted on 23 May 2017

HAL is a multi-disciplinary open access archive for the deposit and dissemination of scientific research documents, whether they are published or not. The documents may come from teaching and research institutions in France or abroad, or from public or private research centers.

L'archive ouverte pluridisciplinaire **HAL**, est destinée au dépôt et à la diffusion de documents scientifiques de niveau recherche, publiés ou non, émanant des établissements d'enseignement et de recherche français ou étrangers, des laboratoires publics ou privés.



HAL Authorization



**LABORATOIRE D'ANALYSE
ET DE TECHNIQUES ÉCONOMIQUES**

UMR 5118 CNRS

DOCUMENT DE TRAVAIL

A
S



Pôle d'Économie et de Gestion

2, bd Gabriel - BP 26611 - F-21066 Dijon cedex - Tél. 03 80 39 54 30 - Fax 03 80 39 54 43

Courrier électronique : secretariat.latec@u-bourgogne.fr

ISSN : 1260-8556

n° 9914

**La rationalité simonienne :
interprétations et enjeux épistémologiques**

Sophie Béjean*, Fabienne Midy et Christine Peyron***

Novembre 1999

**Maître de conférences, Université de Bourgogne*

***Chargée de recherche, CREDES*

Résumé :

Dès lors que l'on s'intéresse aux comportements individuels et que l'on adopte implicitement une démarche d'individualisme méthodologique, le recours à une hypothèse de rationalité individuelle est nécessaire. A côté de l'hypothèse traditionnelle de rationalité dite "substantielle" ou "substantive", d'autres conceptions de la rationalité des comportements individuels se déclinent dans la théorie économique, elles se rattachent souvent à l'hypothèse de "rationalité limitée" développée par Herbert Simon.

Les interprétations de cette notion de rationalité limitée sont très diverses et parfois issues de lectures partielles ou superficielles des travaux de Herbert Simon. Par ailleurs, ces interprétations diverses de la rationalité simonienne se rattachent implicitement à des positions méthodologiques bien différentes : position vis-à-vis de l'individualisme méthodologique, conception des problèmes économiques, statut accordé à l'hypothèse de rationalité, nature du raisonnement économique...

L'objet de cet article est donc d'une part de distinguer les différentes hypothèses de rationalité en précisant la pensée de Simon, grâce à une lecture approfondie de ses écrits et d'autre part de clarifier les différentes positions et implications épistémologiques et méthodologiques implicites au recours à telle ou telle hypothèse de rationalité.

Mots clés

Epistémologie – Herbert Simon – hypothèse de rationalité - rationalité limitée – rationalité procédurale.

Abstract :

Since economics focuses on individual behaviour and implicitly adopt a methodological individualism, an individual rationality hypothesis must be laid down. Beyond the usual substantive rationality hypothesis, others forms of individual rationality can be found in economics theory. They are often related to the Simon's bounded rationality hypothesis.

In the economics literature the meanings of the bounded rationality hypothesis are obviously diverse and sometimes based on a partial or superficial readings of Simon's writings. Moreover, each one of these meanings is implicitly closely linked with a particular methodological and epistemological position.

Based on careful readings of Simon's writings, this paper deals with the characteristic features of the different rationality hypothesis and related them to implicit epistemological choices.

Key words

Epistemology – Herbert Simon – rationality hypothesis – bounded rationality – procedural rationality.

La rationalité simonienne : interprétations et enjeux épistémologiques.

Dès lors que l'on s'intéresse aux comportements individuels et que l'on adopte implicitement une démarche d'individualisme méthodologique, le recours à une hypothèse de rationalité individuelle est nécessaire. Pour pouvoir expliquer, comprendre, les comportements individuels, ceux-ci doivent répondre à des régularités et ces régularités n'apparaissent que si les individus agissent en référence à une norme, un modèle de comportement, qui leur est commun. L'hypothèse de rationalité individuelle constitue cette norme et établit alors le lien nécessaire entre la raison et l'action, ce qui permet d'édifier une théorie du comportement individuel. Le recours à une hypothèse de rationalité correspond donc à une nécessité méthodologique (Popper 1963)¹.

L'hypothèse de rationalité traditionnellement invoquée en économie est l'hypothèse de rationalité dite "substantielle" ou "substantive" (selon la terminologie de Simon, 1976) qui accorde aux individus des capacités et des objectifs particuliers et qui caractérise l'environnement de leurs décisions. Cependant, malgré la prédominance de cette hypothèse dans la théorie économique, d'autres conceptions de la rationalité des comportements individuels sont possibles. Les travaux précurseurs de Herbert Simon, fondés sur le constat de l'irréalisme de l'hypothèse de rationalité substantielle, ont montré que d'autres hypothèses, de "rationalité limitée"², étaient susceptibles de fournir une représentation plus réaliste des comportements individuels.

Cette notion de "rationalité limitée" a connu un certain succès auprès des économistes. En témoignent, par exemple, les travaux de Williamson qui se réfèrent explicitement à une notion de *bounded rationality*, les diverses tentatives de modélisation de la "rationalité limitée" (cf la synthèse récente de F. Laville 1998), les extensions aux notions de "rationalité cognitive" (Walliser 1989), de "rationalité interactive" (Ponssard 1994), de "rationalité située" (Orléan 1994), ou encore le recours à la notion de "rationalité procédurale" par le courant de l'économie des conventions (cf notamment Favereau dans la Revue Economique 1989).

Les interprétations de cette notion de rationalité limitée sont très diverses et ne nous semblent pas toujours fidèles à la pensée de Herbert Simon. Par ailleurs, ces interprétations diverses de la rationalité simonienne se rattachent implicitement à des positions méthodologiques bien différentes.

¹ "L'adoption de ce principe [de rationalité] réduit considérablement le caractère arbitraire de nos modèles, un caractère arbitraire qui deviendrait un véritable esprit de caprice si nous tentions de construire les modèles en nous passant de lui" (Popper, 1963, p.150).

² L'expression "rationalité limitée" peut être considérée pour l'instant comme un terme générique qu'on peut décliner en plusieurs hypothèses qu'il convient de distinguer.

L'objet de cet article sera donc d'une part de distinguer les différentes hypothèses de rationalité en précisant la pensée de Simon grâce à une lecture approfondie de ses écrits, lecture qui nous paraît parfois partielle ou superficielle dans certains travaux se référant à la notion de rationalité limitée, et d'autre part de clarifier les différentes positions méthodologiques implicites au recours à telle ou telle hypothèse de rationalité.

Les interprétations de l'hypothèse simonienne peuvent être regroupées au sein de deux approches différentes de la rationalité limitée qui se rattachent à deux paradigmes différents :

- la première fonde l'hypothèse de rationalité limitée sur les limites des capacités cognitives des individus et la conçoit comme une simple atténuation de la rationalité parfaite ou substantielle ; elle se rattache implicitement au même paradigme que l'hypothèse de rationalité substantielle (première partie) ;
- la seconde met l'accent non seulement sur les capacités cognitives limitées des individus mais aussi sur l'instabilité des états de la nature, elle s'attache non plus à la décision mais au processus de décision ; en cela elle conçoit une autre hypothèse de rationalité individuelle, qui ne résulte pas d'une simple limitation de la rationalité parfaite ; elle appartient à un autre paradigme et relève de choix épistémologiques que nous clarifierons (deuxième partie).

I - De la rationalité substantielle à la rationalité limitée : le paradigme de la rationalité exogène

Le modèle néoclassique, modèle de référence s'il en est, suppose que les comportements individuels sont intelligibles sous l'hypothèse qu'ils répondent à une rationalité parfaite, ou rationalité substantielle. Construit dans un univers abstrait, le modèle n'étudie pas la rationalité des comportements en tant qu'objet de la connaissance, il postule que cette rationalité guide les décisions individuelles. Le statut épistémologique de cette hypothèse est alors celui qui a été défini par M. Friedman (1953) : tout se passe "comme si" les comportements individuels étaient régis par une rationalité parfaite ; il n'est pas nécessaire que cette hypothèse soit réaliste, il suffit que les prédictions du modèle construit sur la base de cette hypothèse soient conformes à la réalité, ou tout du moins qu'elles soient réfutables selon le principe de falsificationnisme cher à Popper.

Mais, malgré cette assurance méthodologique, le caractère particulièrement irréaliste de l'hypothèse de rationalité substantielle peut déboucher sur des résultats ou des explications insatisfaisants. Il s'est alors agi, pour certains auteurs, d'affiner le réalisme des hypothèses comportementales en amendant le modèle de l'*homo œconomicus*. Inspirés par la notion de rationalité limitée initialement développée par Simon (1955), ces auteurs

mettent l'accent sur les limites des capacités cognitives³ des agents économiques et sur le caractère radical de l'incertitude à laquelle ils sont confrontés.

1.1 - De la rationalité parfaite à une rationalité affaiblie

La distinction désormais traditionnelle entre rationalité substantielle et rationalité limitée mérite donc d'être précisée et discutée ; pour ce faire, nous proposons d'explicitier pour chacune de ces deux rationalités les hypothèses posées sur les éléments environnementaux de la prise de décision. Ces éléments peuvent être classés en trois déclinaisons de l'environnement :

- l'environnement objectif défini par les hypothèses concernant les états de la nature en dehors de leur perception par les individus ;
- l'environnement subjectif défini par la connaissance des états de la nature par les individus, éventuellement par les croyances des individus quant à l'avenir, et défini également par leurs préférences des individus ; l'environnement subjectif renvoie à la position de l'individu face à la réalité, tant dans la perception de cette réalité que dans ses volontés face à cette réalité ;
- l'environnement interne de la prise de décision renvoie aux modalités effectives de la prise de décision ; il est défini par les hypothèses concernant le critère de choix, les capacités de calcul et de traitement de l'information des individus.

Une rationalité parfaite : la rationalité substantielle

La prégnance du modèle néoclassique a induit la prédominance en science économique d'une hypothèse de rationalité parfaite : la rationalité substantielle. Celle-ci apparaît comme une rationalité d'ajustement des moyens aux fins : son seul objet est la détermination de l'action pour atteindre le résultat le meilleur possible ; elle est fondée sur une axiomatique de l'intérêt individuel : les individus sont des sujets égoïstes, informés et calculateurs. En outre, elle apparaît comme une rationalité situationnelle puisque, l'objectif étant donné, le comportement individuel ne dépend plus que des contraintes qui conditionnent l'application d'un raisonnement déductif. *"Un comportement est substantivement rationnel lorsqu'il est approprié à l'accomplissement des buts donnés dans les limites imposées par des conditions et des contraintes données"* (Simon 1976, dans MBR II, 1982, p 425).

Ces contraintes, ces conditions et ces buts se traduisent par des caractéristiques objectives de l'environnement externe (l'environnement objectif), des conditions de

³ Nous entendons ici le terme de capacités cognitives au sens large, c'est-à-dire non seulement au sens de capacités d'acquisition et d'accès à l'information mais aussi au sens de capacités de traitement de cette information.

perception de cet environnement (l'environnement subjectif) ou des caractéristiques de l'individu décideur lui-même (l'environnement interne)⁴.

Environnement objectif

Les déterminants objectifs de la décision sont constitués de l'ensemble des états de la nature, c'est-à-dire de l'ensemble des possibilités d'action et de leurs conséquences associées. Dans l'hypothèse de rationalité substantielle, cet ensemble est prédéterminé, l'avenir est préexistant.

Environnement subjectif, information, croyances et préférences

La liste prédéterminée des états de la nature est intégralement connue par l'individu ; l'environnement informationnel est parfait quant aux événements futurs possibles.

Néanmoins, l'avenir peut être incertain, c'est-à-dire que l'individu peut ignorer quel est l'état de la nature qui se réalisera. L'incertitude est alors événementielle : l'avenir est risqué (au sens de Keynes 1921), ou assurable (au sens de Knight 1921), c'est-à-dire que l'individu ne sait pas quel est l'événement qui se réalisera mais il connaît parfaitement la liste des événements possibles.

Par ailleurs, la réalisation d'un événement dépend également des décisions des autres agents économiques. Lors de sa prise de décision personnelle, l'individu ne connaît pas forcément les décisions et stratégies des autres acteurs, mais il possède la connaissance de sa propre méconnaissance : il peut alors intégrer à son calcul des coûts de recherche d'information et les stratégies des autres acteurs détenteurs de l'information qu'il n'a pas. Si l'information sur la réalisation des événements est imparfaite, incomplète ou asymétrique, la connaissance par l'individu de ces imperfections est complète et parfaite.

Lorsque l'avenir est risqué et que l'individu ne peut l'appréhender avec certitude, il est amené à associer des croyances (des probabilités) aux différentes conséquences possibles de ses décisions. Selon l'information qu'il possède sur la vraisemblance des différents états de la nature, l'individu associe des probabilités objectives ou des probabilités subjectives (Savage 1954) à l'occurrence de chacun de ces événements possibles.

⁴ "Les conditions et les contraintes auxquelles il est fait référence dans la définition générique de la rationalité peuvent être les caractéristiques objectives de l'environnement externe de l'organisme décideur, elles peuvent être des caractéristiques perçues, ou elles peuvent être des caractéristiques de l'organisme lui-même, qu'il considère comme fixées et hors de son contrôle" (Simon 1982).

L'individu substantiellement rationnel étant doté de capacités cognitives illimitées, ses capacités d'accès et d'acquisition de l'information ne peuvent être un frein dans l'élaboration de sa perception de la réalité, qu'elle soit exacte ou probabilisée.

Les préférences individuelles sont le dernier élément constituant l'environnement subjectif de l'individu. Ses fins sont données *a priori* par la structure de ses préférences individuelles, prédéterminées et immuables. La théorie néoclassique de la décision ne s'intéresse pas à la genèse de ces préférences et, lorsque leur contenu est étudié, c'est en relation exclusive à l'axiomatique de l'intérêt individuel (*self-interest*). Lorsque des critères comme le juste et le bien sont pris en compte, ils sont réductibles au bonheur des individus, ce bonheur se décomposant en éléments atomisés et mesurables, l'utilité ou la richesse par exemple (Caillé 1989). La stabilité des préférences individuelles est simplement postulée.

Le rôle de l'information comme variable stratégique, source de pouvoir pour celui qui la détient, renforce le caractère purement individualiste des motivations individuelles de la décision : en effet, l'information permet à celui qui la détient d'adopter des comportements opportunistes, si ce n'est immoraux⁵, et d'accroître ainsi son intérêt personnel au détriment de celui des autres et au détriment de l'intérêt général.

Environnement interne, critère de décision et capacités calculatoires

Pour atteindre ses objectifs, l'individu toujours supposé doté de capacités cognitives illimitées, possède notamment toutes les capacités nécessaires au traitement de l'information. Il peut, en particulier, anticiper toutes les conséquences possibles de ses actions et les classer par ordre de préférences. Son critère de décision est alors le calcul, ou plus précisément l'optimisation du résultat, c'est-à-dire des conséquences de sa décision. Son programme consiste donc à maximiser un objectif, fonction de son intérêt personnel, sous des contraintes qui lui sont exogènes, c'est-à-dire imposées par le monde extérieur. En contexte d'incertitude (probabilisable) et d'information asymétrique, le programme d'optimisation de l'individu substantiellement rationnel nécessite de telles capacités calculatoires qu'il confère à l'*homo economicus* le statut de "héros".

Cette hypothèse de rationalité substantielle, parfaite si ce n'est héroïque, devient critiquable pour son irréalisme, dès lors que cet irréalisme ne la rend pas apte à théoriser, représenter certaines situations. En levant certaines des hypothèses concernant l'environnement objectif, subjectif et interne de la décision, l'hypothèse de rationalité limitée

⁵ Pour Williamson (1994, p 70), l'opportunisme est défini comme "*une recherche d'intérêt personnel qui comporte la notion de tromperie*".

fournit un cadre d'appréhension de la rationalité individuelle plus affiné et potentiellement plus riche.

Une rationalité affaiblie : la rationalité limitée

En s'inspirant de la notion de *bounded rationality* initialement développée par Simon, certains auteurs ont cherché à modéliser (par exemple Stigler 1961) ou à utiliser (par exemple Williamson 1994) une hypothèse de rationalité imparfaite, atténuée ou limitée, qui permette de mieux prendre en compte les conditions réelles de la prise de décision individuelle. Plus précisément, il s'agissait d'une part de lever l'hypothèse d'une connaissance parfaite de l'avenir, ce qui modifie partiellement l'environnement subjectif de la prise de décision, et d'autre part de tenir compte de la limitation des capacités de calcul des individus, ce qui modifie l'environnement interne du décideur.

Un accès imparfait à l'environnement objectif

L'hypothèse d'un environnement informationnel parfait, qui suppose que les individus connaissent parfaitement la liste des événements futurs potentiels, est irréaliste et cela pour deux raisons : d'une part parce que l'individu, pour des raisons cognitives, ne peut pas avoir accès à toute l'information possible, d'autre part parce que l'avenir se construit au gré des décisions successives et des irréversibilités qui modifient l'éventail des choix possibles.

L'hypothèse de la rationalité limitée n'intègre qu'une partie de cette incertitude (liée à la première cause d'irréalisme), à savoir l'incertitude que Viviani qualifie de "subjective" (1994) : l'ensemble des états de la nature reste prédéterminé mais l'individu ne peut pas en avoir une connaissance immédiate. Cette hypothèse de rationalité donne à la prise de décision le même environnement objectif que l'hypothèse de rationalité substantielle mais en modifie l'environnement subjectif ; l'environnement informationnel est imparfait quant aux événements futurs possibles toujours préexistants à la décision.

Au moment de sa prise de décision, l'individu ne possède qu'une partie de l'information disponible sur l'avenir. Il découvre donc au cours du temps l'existence d'opportunités non encore exploitées : *"le paysage existe déjà, mais il est souvent si complexe qu'il est toujours possible de découvrir de nouveaux sentiers"* (Viviani 1994, p.115). L'incertitude porte alors non seulement sur la vraisemblance des événements futurs, mais aussi sur les événements eux-mêmes, ou plus précisément sur la connaissance que les individus en ont.

Des croyances irréductibles à des probabilités

Si la liste des événements futurs n'est pas connue *a priori* par l'individu, il ne peut associer des probabilités à chacun de ces événements. Les croyances de l'individu sont alors irréductibles à des probabilités, qu'elles soient objectives ou même subjectives. On distingue alors à la suite de Knight (1921) les notions de risque (probabilisable et donc assurable) et d'incertitude (non probabilisable). Cette incertitude possède ici un caractère purement "subjectif" (selon la terminologie de Viviani, 1994), puisqu'elle résulte seulement d'un problème d'accès à la connaissance des états du monde par l'individu.

Par ailleurs, dans le modèle de la rationalité limitée comme dans celui de la rationalité substantielle, la valeur subjective des fins est exogène à la prise de décision, les préférences de l'individu sont données et immuables, leur genèse n'est pas interrogée. Toutefois, le modèle de la rationalité limitée concevant une connaissance évolutive de la liste des états de la nature, on peut admettre que l'individu puisse compléter l'ordre de ses préférences lors de l'acquisition de nouvelles informations, sans que bien sûr l'ordre des préférences individuelles sur les états déjà connus ne change (Midy 1997).

Des capacités cognitives limitées

Les travaux de Simon (1955...) montrent que le modèle de rationalité substantielle, en supposant des capacités cognitives illimitées, mésestime les limites internes de la rationalité individuelle. Si les capacités cognitives sont limitées, elles entravent à la fois la perception de l'environnement objectif, et la calculabilité effective du raisonnement. Elles induisent, par rapport à la rationalité substantielle, un nouvel environnement subjectif et un nouvel environnement interne.

La faiblesse des capacités cognitives de l'individu limite son accès à l'information et restreint l'utilisation des informations disponibles. Il convient alors de mettre l'accent sur l'environnement subjectif du décideur, c'est-à-dire sur "*sa capacité à se représenter un réel plausible*" (Giordano 1991). Les capacités perceptives de l'observateur sont réduites, la réalité n'est pas connue mais ne peut qu'être découverte, d'une manière qui reste toujours partielle. L'impossibilité de connaître les états du monde ne renvoie pas au statut du futur, toujours supposé prédéterminé, mais aux limites de la puissance des capacités cognitives. Et plus encore, même si cet avenir prédéterminé était connu des individus, on pourrait douter de la maîtrise des individus quant aux règles du calcul bayésien et à l'inférence statistique. En ce sens, l'avenir est incertain, c'est-à-dire non probabilisable objectivement par les individus.

La faiblesse des capacités cognitives limite aussi la calculabilité effective du raisonnement. L'individu substantiellement rationnel fonde sa prise de décision sur le calcul, ses ressources computationnelles sont censées lui permettre de raisonner

déductivement et d'optimiser parfaitement le résultat de sa décision en maximisant son objectif sous contraintes. Or le modèle de la rationalité limitée ajoute à l'imprécision dans la détermination de l'environnement subjectif, une faiblesse interne du calcul voire du raisonnement.

Ainsi, l'individu n'a pas les capacités cognitives nécessaires pour envisager toutes les conséquences possibles de sa prise de décision, associer des probabilités à ces différentes conséquences et événements futurs, tenir compte de sa propre méconnaissance de certaines informations, intégrer les comportements stratégiques des autres acteurs, calculer l'utilité espérée qu'il retirerait de ces différentes situations, et, enfin, choisir la décision qui lui apporterait le plus de satisfaction.

Le modèle de la rationalité substantielle met en scène un acteur théorique qui se présente comme un espèce de génie dans un monde simplifié⁶ ; ce programme "héroïque" est trop irréaliste : les capacités cognitives des individus sont limitées, leur rationalité l'est aussi. L'hypothèse de la rationalité limitée aménage cette vision "idyllique" de la décision en adoptant une position plus réaliste. La rationalité limitée s'interprète alors comme une rationalité affaiblie à laquelle on se résoudra en regrettant que la logique mathématique pure ne puisse être un guide pour l'action humaine. L'individu n'est plus omniscient, dans le sens où il ne dispose pas de l'information de manière immédiate, mais il peut la rechercher, dans la mesure où elle existe, en suivant une procédure de recherche d'informations, qui reste d'ailleurs optimisatrice, c'est du moins l'option retenue par les modèles de *search* (Stigler 1961). Moins qu'une critique fondamentale de la rationalité substantielle, la rationalité limitée serait son visage contraint par une nature plus réaliste de l'environnement décisionnel.

1.2 - Un même rattachement paradigmatique

En se démarquant du modèle idyllique de la rationalité substantielle, le modèle de la rationalité limitée propose un modèle de décision individuelle plus réaliste. En effet, compte tenu de la teneur de l'environnement subjectif et interne de la prise de décision individuelle, la rationalité ne peut plus être parfaite. Elle est alors affaiblie ou atténuée, en référence avec une norme qui reste la rationalité substantielle parfaite. En ce sens, la rationalité limitée, telle que nous l'avons préalablement définie, ne représente pas une

⁶ "Le décideur contemple et comprend de manière immédiate tout ce qui s'offre à lui. Il accède à l'ensemble des alternatives de choix possibles, non seulement dans le présent, mais également dans le futur. Il comprend les conséquences de chacune des stratégies de choix possibles, au point d'être capable d'assigner des distributions de probabilité aux états du monde futurs. Il a confronté ou concilié toutes ses valeurs partielles contradictoires, et les a synthétisées dans une fonction d'utilité unique, qui ordonne tous les états du monde futurs, selon ses préférences" (Simon, 1983)

critique fondamentale de la rationalité substantielle mais appartient finalement au même paradigme.

Il était important, pour définir rationalité substantielle et rationalité limitée, de souligner les divergences entre ces deux notions, en particulier en ce qui concerne les hypothèses portant sur l'environnement subjectif et interne de l'individu. Il est important maintenant de souligner les convergences entre ces deux notions pour montrer qu'elles appartiennent au même paradigme que nous qualifierons de paradigme de la "rationalité exogène".

L'environnement objectif permet d'évaluer de la décision

L'hypothèse de la rationalité limitée admet que l'individu puisse avoir une connaissance non immédiate de l'environnement objectif, néanmoins ces contraintes préexistantes jugent de la décision, même si elles sont partiellement connues, et déterminent la décision à prendre, ou les décisions séquentielles à prendre en fonction de l'accès à de nouvelles informations. Le "meilleur" est prédéterminé par les conditions de l'environnement (états de la nature, informations disponibles...). En ce sens, la décision peut être rationnelle et la rationalité reste "exogène", c'est-à-dire que la décision "la meilleure" reste prédéterminée par les contraintes objectives de l'environnement.

Les motivations subjectives de la décision restent individualistes

En passant d'une hypothèse de rationalité substantielle à celle d'une rationalité limitée, on ne s'intéresse toujours pas à la nature des préférences individuelles. Celles-ci restent données, prédéterminées, même si l'individu peut les compléter en fonction d'informations nouvelles, et, dans tous les cas, les préférences restent définies dans le cadre d'une hypothèse de *self-interest*. L'axiomatique de l'intérêt individuel n'est pas du tout remise en cause par l'hypothèse de rationalité limitée. Les fins subjectives de l'individu s'expriment dans les mêmes termes, même si elles sont plus difficiles à atteindre en raison des limites de ses capacités cognitives.

En outre, la finalité de l'action reste la conséquence de la décision individuelle. Ce qui motive l'individu dans sa prise de décision, ce sont les conséquences attendues de cette décision ; les préférences portent sur les conséquences de l'action et non sur l'action, ou la décision, elle-même. En ce sens, la rationalité limitée, comme la rationalité substantielle, relèvent d'un principe de "rationalité conséquentialiste" (Le Menestrel 1997).

Le critère de choix reste l'optimisation

Malgré des capacités cognitives et computationnelles limitées, l'individu exerce un même critère de décision, à savoir le calcul, c'est-à-dire plus précisément l'optimisation des conséquences de sa décision. Essentiellement, rationalité substantielle et rationalité limitée

renvoient à la même spécification du raisonnement humain, le paradigme de la résolution par réduction et déduction⁷. Dans l'une et l'autre, l'individu cherchera à simplifier le problème jusqu'à ce qu'il ait une forme déductible, les règles déductives dont il dispose lui permettent alors d'atteindre le but qu'il s'était fixé (Le Moigne 1995). Le résultat est alors toujours évaluable objectivement en comparant le résultat obtenu au "résultat optimal" à atteindre (Béjean Peyron 1997). La solution rationnelle est une donnée exogène, dictée par la résolution du programme optimisateur, fut-il de *search*. L'autonomie de l'individu ne s'exerce alors que dans l'ordonnement de ses préférences subjectives.

Cette relation entre capacités cognitives limitées et optimisation n'est pas le moindre des paradoxes des tentatives de modélisation de la rationalité limitée. Laville (1998) montre que les différents modèles de rationalité limitée entretiennent un lien étroit avec l'optimisation, soit comme procédure de décision, soit comme résultat d'un autre processus (d'apprentissage ou d'évolution par exemple). Les modèles de "coûts" (qui cherchent à minimiser le coût de la décision), dans la lignée des modèles de *search* de Stigler, accentuent finalement les capacités de calcul nécessaires pour prendre la décision : l'individu est doté de la connaissance de sa propre méconnaissance, il sait qu'il ne possède pas immédiatement toutes les informations existantes, il sait également que la recherche de ces informations est coûteuse, il est alors capable d'intégrer les coûts de sa méconnaissance ou, paradoxalement, les coûts de la limitation de ses capacités cognitives à son calcul d'optimisation. Plus qu'un "héros", l'individu apparaît alors comme un "super héros". Malgré les buts affichés de prise en considération de certaines caractéristiques de la réalité (limites d'information et de calcul des agents), ces modèles sont loin de construire une représentation plus réaliste de la prise de décision : *"ces modèles dotent les agents d'importantes capacités de calcul et viennent donc finalement se ranger dans la classe des modèles de rationalité parfaite"* (Laville 1998, p.342). Fondamentalement, rationalité substantielle et rationalité limitée (ainsi définies) appartiennent donc au même paradigme de "rationalité exogène".

Cette interprétation de la notion de rationalité limitée, inspirée des travaux précurseurs de Simon, se présente finalement plus comme un aménagement du modèle de la rationalité substantielle destiné à mieux prendre en compte certaines caractéristiques de la réalité. Le "noyau dur" du modèle substantiel, à savoir les hypothèses d'optimalité et d'individualisme, ne sont pas remises en cause et subsistent.

Toutefois, une lecture plus approfondie des travaux de Simon laisse entrevoir une critique plus radicale du modèle de la rationalité substantielle et un véritable changement de paradigme.

⁷ La résolution est donc conforme au principe de raison suffisante cher aux philosophes de la Raison comme Descartes ou Leibniz : ramener le complexe au simple, le multiple au semblable pour utiliser la voie déductive conformément au modèle des mathématiques.

II - De la rationalité limitée à la rationalité procédurale : le paradigme de la rationalité endogène

Si on considère que les hypothèses comportementales doivent être réalistes pour rendre compte de l'intégralité et de la complexité des comportements individuels, la prise de décision devient alors objet de la connaissance. Les comportements individuels sont intelligibles pour autant qu'ils sont appréhendés à partir d'une hypothèse comportementale réaliste. Il devient alors important, si ce n'est fondamental, de s'intéresser à la psychologie de l'individu, à l'origine de ses motivations, aux procédures de raisonnement qu'il met en œuvre pour décider. Le modèle de la rationalité substantielle, même amendé pour tenir compte de certaines caractéristiques de la réalité, ne correspond pas à ce projet. En revanche, le modèle de la rationalité procédurale développé par Simon (1976) répond à cette exigence.

Lorsque l'environnement est non seulement opaque mais indéterminé, la décision rationnelle n'est alors plus *exogène*, déterminée par les caractéristiques et la perception de l'environnement et dictée par la résolution du programme optimisateur, elle devient *endogène*⁸. La conception de la rationalité qui en découle relève alors d'un autre paradigme, la rationalité porte sur la prise de décision et non plus sur la décision.

2.1 D'une rationalité parfaite, voire limitée, à la rationalité procédurale

Pour expliquer le passage d'une rationalité parfaite, voire affaiblie, à la rationalité procédurale, nous reprendrons la déclinaison en trois niveaux de l'environnement, l'environnement objectif, subjectif et interne de l'individu ; néanmoins ces trois niveaux font plus difficilement l'objet d'un traitement séquentiel, étant dialectiquement liés dans le cadre de la rationalité procédurale. Dans l'hypothèse de *bounded rationality* ou de *procedural rationality* proposée par Simon, chacun de ces niveaux oppose la rationalité simonienne aux hypothèses de rationalité parfaite ou affaiblie.

⁸ La terminologie n'est pas neutre : en effet, le terme de *bounded rationality* adopté par Simon a souvent été traduit par "rationalité limitée" ; ce choix nous semble trahir la pensée de Simon dans la mesure où il laisse entrevoir la possibilité d'une rationalité qui serait supérieure, car "non limitée". C'est d'ailleurs l'interprétation qui en est donnée dans la première partie de cet article et qui est développée par des auteurs comme Stigler en tant que modélisateur de la rationalité ou Williamson, Jensen et Mekling... en tant qu'utilisateurs d'hypothèse de rationalité. Il nous semble au contraire, et c'est ce que nous allons essayer de montrer dans cette deuxième partie, que la notion de *bounded rationality* renvoie à une rationalité de nature différente, sans connotation hiérarchique. Il est alors important de marquer la rupture avec la conception précédente en retenant une terminologie différente : nous avons donc choisi le terme de rationalité *endogène* à la suite de J.L. Le Moigne.

Une rationalité endogène : la rationalité procédurale

La rationalité procédurale n'est pas une extension de la rationalité limitée, ni une forme plus noble de cette rationalité où l'individu revendiquant les limites de son exercice cognitif disposerait de ruses pour les dépasser. La rationalité procédurale n'interroge plus l'adéquation des moyens à des fins prédéterminées, mais s'attache à la rationalité effective dans l'utilisation de la pensée et de l'action. L'objet du discours s'est déplacé ; c'est maintenant dans l'élaboration même du processus cognitif que la rationalité de l'individu et de son comportement se manifeste. En ouvrant l'analyse à la psychologie de la décision, le modèle de la logique classique de réduction et déduction perd de sa pertinence pour la formulation et la résolution d'un problème ; l'individu qui raisonne est un individu qui délibère dans un univers complexe (environnement objectif), en fonction de valeurs subjectives évolutives (environnement subjectif), selon des règles de décision procédurales (environnement interne).

Un univers qui se construit

La rationalité substantielle suppose un environnement informationnel parfait quant à la liste des états de la nature (les événements futurs possibles) ; la rationalité limitée quant à elle accepte que l'individu ait un accès imparfait aux informations relatives à cet environnement objectif. Néanmoins, ces hypothèses supposent toutes deux que les individus prennent leurs décisions en fonction d'un avenir préexistant, même s'ils en ont une connaissance non immédiate. Or si les conséquences des décisions individuelles façonnent l'avenir, ce sont les individus eux-mêmes qui déterminent l'étendue des possibles (Dupuy 1989). L'environnement objectif est simultanément donnée et résultat de la prise de décision.

Dès lors que l'on suppose que les savoirs ne sont pas figés dans le temps et donc immuables, que les décisions successives des individus produisent des irréversibilités qui modifient l'éventail des événements possibles, que le progrès technique joue un rôle primordial dans la construction de l'avenir, alors on ne peut plus postuler que la liste des états de la nature soit préalable à la prise de décision. Le futur est non seulement inconnu, mais il est inexistant car il est créé par l'imaginaire des hommes. Il existe une rationalité de la découverte (Simon 1988) qui ne peut s'exercer sous l'hypothèse d'un avenir connu, les inventions en sont la meilleure preuve. Prévoir une invention signifierait qu'elle aurait déjà été pensée, et donc découverte! (Simon, Schaeffer, 1992).

Une incertitude radicale et des valeurs subjectives diverses et évolutives

L'incertitude qui entache l'environnement subjectif n'est alors pas seulement risquée, ni même subjective. Elle est radicale (au sens de Knight 1921 ou Keynes⁹, selon la typologie de Viviani 1994), endogène (Ménard 1989), épistémique (Orléan 1989) ou critique (Thévenot 1989). Lorsqu'on reconnaît que les connaissances évoluent dans le temps, et que les événements "nouveaux" (Orléan 1989) sont irréductibles aux données antérieures, on ne peut plus associer des probabilités aux événements futurs qui peuvent être inconnus au moment de la prise de décision.

Si l'incertitude est radicale, et donc non probabilisable, les croyances des individus sont irréductibles à des probabilités, fussent-elles subjectives : la maximisation d'une utilité espérée, l'utilisation des règles du calcul bayésien et, plus généralement, le principe de réduction-déduction deviennent alors impossibles.

Dans le cadre de l'hypothèse de rationalité simonienne, les objectifs mêmes de l'individu, les valeurs subjectives qu'il poursuit, ne sont pas prédéterminés et ne sont pas indépendants des croyances de l'individu. D'ailleurs, l'ensemble des motivations de l'individu ne peut être résumé en un seul ordre de préférences (Sen 1977)¹⁰ et celles-ci ne peuvent être supposées stables et immuables, du moins est-ce ce qui résulte des nombreuses expérimentations empiriques (Willinger 1996). Au contraire, les préférences sont changeantes en fonction d'informations nouvelles et en fonction de l'expérience concrète des situations¹¹ : elles se construisent par apprentissage et deviennent un objet d'étude pertinent pour l'économiste.

En permettant aux objectifs de l'action de se construire pendant le processus de décision, l'hypothèse de rationalité simonienne autorise des motivations plus larges que le simple utilitarisme prégnant dans le modèle de la rationalité substantielle. L'individu peut intégrer dans ses motivations l'intérêt général, l'équité ou l'altruisme... La tromperie, et son

⁹ "Il me faut expliquer que, par l'expression de connaissance "incertaine", mon intention n'est pas simplement de distinguer ce qui est su avec certitude de ce qui est simplement probable. Le jeu de la roulette n'est pas sujet à l'incertitude dans ce sens (...). Le sens dans lequel j'utilise ce terme est celui selon lequel la perspective d'une guerre européenne était incertaine, ou encore le prix du cuivre et le taux d'intérêt dans vingt ans, ou la date d'obsolescence d'une innovation(...). En ces matières, il n'y a pas de fondement scientifique sur lequel on puisse formuler, de façon autorisée, quelque raisonnement probabiliste que ce soit. Nous ne savons pas, tout simplement" (Keynes, 1937, p 114)

¹⁰ "On attribue à la personne un seul classement des préférences, et au gré des besoins, ce classement est supposé refléter les intérêts de la personne, représenter son bien-être, résumer son opinion sur ce qu'il convient de faire, et décrire ses choix et son comportement effectifs. Un seul classement des préférences peut-il remplir tous ces rôles ?" (Sen 1977, p 106). L'ironie du ton ne laisse aucun doute quant à la réponse de Sen, précisée plus loin : "la théorie économique s'est beaucoup occupée de cet idiot rationnel, drapé dans la gloire de son classement de préférences unique et multifonctionnel" (1977 p 107).

¹¹ Le cas de la confrontation à la douleur ou à la maladie est significatif comme le montre l'exemple désormais connu des préférences des femmes par rapport à l'anesthésie lors de l'accouchement : les femmes qui refusent une péridurale avant les premières douleurs finissent par la demander au cours du travail (Christensen-Szalanski 1984).

corollaire la défiance, qui caractérisent l'opportunisme, peuvent être remplacés par la confiance.

La rationalité substantielle s'avère en effet incapable d'intégrer d'autres motivations individuelles que celles issues de l'axiomatique de l'intérêt. En limitant les motivations à des objectifs individualistes, elle s'interdit de penser la particularité de l'altruisme et du désintéressement et dénature l'idée du don (Batifoulier et al. 1992). L'altruisme devient une source de satisfaction pour l'individu, directement ou indirectement : directement lorsqu'il est considéré comme un argument supplémentaire de l'utilité individuelle, et indirectement lorsqu'il permet aux individus de parfaire leur réputation. L'altruisme et les dons désintéressés ne se justifient alors que dans la perspective d'un bénéfice ultérieur perdant ainsi toute spécificité.

Or, même si ces comportements relevant du don et de l'altruisme ne sont pas gratuits, on ne peut en faire des phénomènes exclusivement intéressés. La rationalité simonienne permet d'intégrer dans la détermination des motivations subjectives un système de valeurs et de croyances qui autorise la prise en considération de valeurs différentes de l'utilitarisme, sans pour autant exclure l'intérêt individuel pour les avantages matériels. L'altruisme doit alors être compris au sens du don-contre-don de M. Mauss (1985), c'est-à-dire non pas au sens du désintéressement absolu, gratuit et sans retour, mais au sens d'un "égoïsme éclairé" (Simon 1983) qui trouve sa place entre le don purement gratuit et l'échange purement intéressé.

Des règles de décision procédurales

Lorsque l'incertitude est radicale, que les préférences sont évolutives tout autant que diversifiées, le calcul, ou l'optimisation du résultat de la décision, n'est plus approprié pour expliquer la prise de décision par l'individu. Ce ne sont pas seulement les limites des capacités cognitives des individus qui contribuent à écarter le modèle de la rationalité substantielle. C'est un autre mode de prise de décision qui est envisagé : les individus vont utiliser des principes heuristiques, des raisonnements types, leurs expériences, voire leur intuition.

La rationalité est alors procédurale : Simon propose en effet de définir le critère de rationalité d'une décision, non plus en fonction de la conséquence attendue de la décision (utilité ou profit), mais en fonction de la cohérence du raisonnement qui a conduit à cette décision¹². Dans le cadre de ce processus de décision, les valeurs subjectives de l'action et les moyens utilisés pour les poursuivre s'élaborent conjointement. Ni l'objectif de l'individu, ni les modalités d'accès à cet objectif ne sont désormais prédéterminés. La

¹²*Le comportement est procéduralement rationnel s'il est le résultat d'une délibération appropriée"* (Simon, 1976, p 131)

rationalité de l'individu s'exerce dans la recherche d'une procédure apte à définir à la fois l'objectif recherché et les moyens d'y parvenir.

Cette procédure de décision se caractérise par deux mécanismes essentiels : un mécanisme de recherche par lequel l'individu détermine les options d'action possibles (Simon 1979a), et une règle de décision particulière : le "*satisficing*"¹³.

Ce mécanisme de recherche peut être représenté de façon séquentielle, même si lors du raisonnement les différentes séquences sont menées conjointement :

— au début du processus de décision, l'individu définit un niveau d'aspiration, qui correspond à une situation hypothétique désirée par l'agent. Ce niveau d'aspiration est susceptible de varier au cours du processus de décision, en fonction des préférences éventuellement changeantes de l'individu, en fonction des informations nouvelles obtenues, ou en fonction de la difficulté (ou de la facilité) d'atteindre ce niveau d'aspiration. Niveau d'aspiration et décision deviennent des variables dialectiquement liées ;

— après avoir défini un premier niveau d'aspiration, l'individu explore un nombre limité de décisions susceptibles de le conduire à cette situation *a priori* désirable. Au cours de cette recherche, l'individu met en œuvre un raisonnement qui fait appel, non pas au principe de réduction-déduction, mais à l'expérience, à la mémoire, à des raisonnements types, à l'intuition¹⁴.

C'est alors la règle de décision qui détermine l'arrêt de la recherche. Le processus de décision est en effet à son terme lorsqu'une solution satisfaisante est trouvée. La règle du "*satisficing*" met en œuvre un mécanisme de comparaison et un mécanisme d'ajustement :

— le mécanisme de comparaison permet à l'individu de comparer la situation obtenue à l'issue de la recherche avec la situation désirée initialement. Les conséquences d'une action envisageable sont donc évaluées au regard du niveau d'aspiration de l'individu. Si l'action évaluée est satisfaisante alors la décision est prise¹⁵ ; dans le cas contraire, une autre action est à rechercher pour satisfaire le niveau d'aspiration présent, à moins que l'impossibilité d'une solution n'amène à redéfinir le niveau d'aspiration recherché ;

¹³ "Le raisonnement humain, produit de la rationalité endogène, peut être caractérisé par une recherche sélective à l'intérieur d'un large espace de possibilités. La recherche s'arrête lorsqu'une solution satisfaisante a été trouvée" (Simon 1992).

¹⁴ Cette recherche peut donc être le fruit d'une délibération réfléchie ou non, auquel cas on peut alors parler d'intuition. L'intuition permet à l'individu de trouver une solution de manière soudaine et sans délibération préalable, du moins en apparence. En fait, l'individu reçoit un stimulus qu'il reconnaît car il en a déjà fait l'expérience. "L'intuition est la capacité de reconnaître un ami, et de puiser dans la mémoire toutes les choses que nous avons apprises sur cet ami au cours des années ou nous l'avons connu" (Simon 1983, p 202). La délibération existe, mais elle s'est effectuée antérieurement.

¹⁵ "Est choisie non pas l'action la meilleure relativement aux conditions objectives et subjectives de la décision, mais une action satisfaisante, c'est-à-dire dont l'évaluation est supérieure au niveau d'aspiration, ou seuil de satisfaction, du sujet" (Mongin 1984, p 31).

— c'est alors le mécanisme d'ajustement qui permet à l'individu de revoir son niveau d'aspiration en fonction des difficultés ou des facilités rencontrées pour l'atteindre¹⁶. Ce critère de satisfaction autorise donc la révision de l'objectif au cours du processus de décision à l'inverse du critère de maximisation de la rationalité substantielle.

Ainsi la rationalité procédurale n'a-t-elle pas à être jugée dans un ajustement des moyens aux fins puisque ces fins ne sont pas prédéfinies. La rationalité substantielle est parfaite en ce qu'elle est parfaitement efficace pour atteindre un résultat prédéterminé. La rationalité procédurale ne peut, en référence, être qualifiée d'imparfaite ou de limitée, elle est tout aussi entière dans son objet, à savoir les conditions d'utilisation de la pensée et de l'action. Dans un environnement particulier, où les objectifs sont donnés, l'environnement parfaitement décrit et les règles déductives évidentes, la rationalité procédurale peut impliquer d'utiliser un raisonnement optimisateur. En ce sens, et dans certains cas particuliers, rationalité procédurale et rationalité substantielle se rejoignent. Néanmoins, c'est sur le plan épistémologique qu'elles sont opposées : elles correspondent en effet à deux paradigmes différents et, même plus, incomparables.

2.2 Un véritable changement de paradigme

En passant de l'hypothèse de rationalité substantielle à l'hypothèse de rationalité procédurale, on opère un véritable changement de paradigme. Il ne s'agit plus, en effet, d'aménager le modèle de la rationalité substantielle pour tenir compte de certaines caractéristiques de la réalité, la levée de certaines hypothèses (capacités cognitives, traitement de l'incertitude...) permettant de répondre à une exigence accrue de réalisme dans les hypothèses comportementales. Il s'agit de construire une représentation réaliste des comportements individuels qui vise tout à la fois les déterminants objectifs de l'action, les motivations subjectives de la décision et les modalités concrètes mises en œuvre dans la prise de décision.

Le projet lui-même est différent. Les comportements individuels deviennent explicitement et entièrement objet de l'analyse : les valeurs subjectives (les préférences selon la terminologie du modèle de rationalité substantielle) et les processus cognitifs ne sont plus à l'extérieur du champ d'analyse de l'économiste, leur interrogation devient au contraire un élément essentiel d'une appréhension réaliste des comportements. Ce faisant, le statut épistémologique de l'hypothèse de rationalité change également : d'une hypothèse instrumentale utilisée dans un univers abstrait pour garantir la logique d'un raisonnement

¹⁶"Si l'individu, dans son exploration des alternatives, trouve facile de découvrir des options satisfaisantes, son niveau d'aspiration se relève ; s'il trouve cela difficile, son niveau d'aspiration baisse" (Simon 1955, p 111)

déductif, on passe à une hypothèse qui devient objet de la connaissance et est construite dans un univers concret pour analyser les comportements individuels.

Ce changement de paradigme se traduit directement au niveau de la conception de la rationalité individuelle, mais il se traduit également par une nouvelle conception de l'économie et une autre démarche méthodologique.

Concevoir la rationalité individuelle

La conception simonienne de la rationalité implique le passage à un autre paradigme : d'une rationalité "exogène" déterminée essentiellement, à niveau de préférences donné, par les caractéristiques objectives de l'action, prédéterminées et fixes, on passe à une rationalité "endogène" où l'individu doit trouver en lui-même les bases d'un comportement rationnel. L'individu détermine conjointement les valeurs subjectives qui le motivent, les buts qu'il poursuit et les moyens d'y parvenir.

La richesse de ce paradigme tient très certainement à ce caractère endogène de la rationalité : cela lui confère une force d'adaptation à la réalité du système qu'il vise à analyser, système complexe, évolutif et empreint de valeurs diverses.

Comme le rappelle H. Simon dans la dernière édition de "The science of artificial" (1996), lorsque la situation est idéalement simple (l'objectif, par exemple la maximisation du profit, définit parfaitement l'environnement interne de l'agent, les courbes de coûts et de recettes définissent parfaitement son environnement externe), l'adaptation de l'environnement interne à l'environnement externe peut alors se réaliser à travers le critère d'optimisation, caractéristique de la rationalité substantielle. Mais *"à chaque pas vers le réalisme, le problème se déplace graduellement du choix de la meilleure façon d'agir (rationalité substantielle) à la recherche du moyen de déterminer, de manière très approximative, où se situe une bonne façon d'agir (rationalité procédurale)"* (H. Simon, 1996, p.27).

En ce sens, la conception simonienne de la rationalité implique le passage d'une conception téléologique à une conception axiologique de la rationalité individuelle. Selon la première, une action est rationnelle lorsqu'elle est objectivement la mieux adaptée à la fin recherchée ; selon la seconde, une action est rationnelle ou plus précisément un processus de décision est rationnel lorsqu'il peut être justifiée par un raisonnement délibératif¹⁷.

Cette conception endogène de la rationalité enrichit l'analyse dans plusieurs directions.

¹⁷ Du type "A avait de bonnes raisons de faire B, car il croyait que C, or il avait de bonnes raisons de croire C car...".

— Elle permet d'envisager un environnement décisionnel évolutif qui se construit au gré des actions et de l'imagination des hommes. Il n'y a plus une, et unique, décision rationnelle, mais des manières rationnelles de prendre les décisions en fonction des informations sélectionnées, de l'évolution de l'environnement et en fonction de valeurs qui peuvent également évoluer.

— Elle autorise une plus grande richesse cognitive en multipliant les moyens d'accéder à la décision. Ceux-ci ne se limitent plus au calcul et au principe de réduction-déduction, mais s'étendent à la délibération et au respect d'heuristiques, de normes sociales, de modèles de comportement... Ainsi la rationalité procédurale autorise-t-elle une plus grande richesse cognitive que la simple mise en œuvre d'une règle de calcul. En cela, les capacités cognitives des individus ne sont pas limitées mais au contraire plus étendues et plus complexes si on les juge au regard d'un critère de rationalité procédurale.

— Elle autorise une plus grande liberté quant au critère de décision à retenir. Puisque dans le monde réel l'optimum ne peut plus servir de norme décisionnelle (Simon 1996, p.29), l'acteur économique accepte des alternatives qu'il juge suffisamment bonnes en fonction d'un niveau d'aspiration qui lui est propre. Les critères de décision ne peuvent alors plus faire référence à l'optimalité du résultat de la décision, mais à la satisfaction des procédures mises en œuvre. Ce faisant, l'objet de la rationalité s'est déplacé du résultat "décision" à l'action de "décider".

— Quant aux valeurs qui motivent l'action, elles sont diverses et irréductibles au pur individualisme de l'hypothèse de rationalité substantielle. En autorisant le respect de valeurs altruistes, désintéressées, ou collectives, on élargit la conception même de l'individu qui n'agit plus dans un univers désincarné, dépourvu de lien social, mais s'intègre au contraire dans une société où le collectif ne peut être réduit à la somme des éléments qui le composent, où des normes sociales guident également les comportements, en plus de valeurs plus individualistes.

Concevoir l'économie

Cette conception renouvelée de la rationalité et de l'individu est liée implicitement à une autre conception de l'économie. D'une économie d'allocation des ressources, on passe à une économie de création de ressources (Brousseau 1993). Concevoir l'environnement objectif comme étant en perpétuelle évolution, non prédéterminé, implique une incertitude radicale qui appelle une rationalité de la découverte. *"Une théorie qui traite des problèmes de formation et de création de solutions alternatives peut fournir la base d'une théorie économique du changement et du développement"* (Simon 1992, p.5). Cette "théorie" de la rationalité autorise donc de prendre en compte non seulement les problèmes d'échange des ressources déjà existantes, mais aussi les problèmes de création de ressources nouvelles. L'évolution des savoirs et des savoir-faire peut alors être intégrée au champ de l'analyse

économique. Il est d'ailleurs remarquable, à ce sujet, que les travaux de Simon sur la rationalité des processus cognitifs portent autant sur les modalités de l'action individuelle que sur la logique de la découverte scientifique. En produisant un raisonnement caractérisé par un processus de recherche séquentielle et sélective, la rationalité procédurale est tout à fait à même, au niveau individuel comme au niveau souvent collectif de la découverte scientifique, d'intégrer dans la détermination des objectifs l'acquisition de connaissances. En cela, elle répond aux exigences d'une économie de création de ressources, qu'il s'agisse de produire des ressources nouvelles ou d'innover en organisant différemment la production.

Une telle conception de l'économie est dépourvue de la notion d'optimum : en se situant dans le cadre d'une économie de création de ressources où l'avenir se construit au gré notamment des décisions individuelles et de l'action des hommes, on ne peut comparer une allocation des ressources à une autre allocation des ressources jugée optimale. Une situation peut être jugée provisoirement préférable à d'autres, mais la référence idéale de l'optimum n'existe pas. La position de l'économiste en matière d'aide à la décision devient alors moins confortable. Dépourvu d'une référence idéale ("l'optimum") et d'une méthode ("le calcul économique") qui confèrent une valeur normative à ses prescriptions, l'économiste doit alors rechercher la valeur normative de ses analyses dans le cadre d'une autre méthodologie économique.

Adopter une démarche méthodologique

Le passage d'une hypothèse de rationalité exogène à une rationalité endogène a des implications non négligeables en matière de choix méthodologique : position vis-à-vis de l'individualisme méthodologique, conception des problèmes économiques, statut accordé à l'hypothèse de rationalité, nature du raisonnement économique... sont interrogés lors de ce passage.

La conception de l'individu que suppose implicitement l'adoption d'une hypothèse de rationalité procédurale interroge en effet la démarche méthodologique adoptée. L'étude des comportements individuels réalisée dans ce contexte ne relève plus d'un individualisme méthodologique pur. En acceptant que l'individu puisse être influencé dans ses décisions par des valeurs altruistes, collectives, par des conventions ou par des normes sociales, on se situe dans une position intermédiaire entre l'individualisme méthodologique pur et le holisme (Brochier 1994). La démarche adoptée relève alors d'un individualisme méthodologique complexe tel que les économistes des conventions le conçoivent (Revue Economique 1989) : entre l'individualisme méthodologique de la théorie néo-classique ("les seuls acteurs sont des personnes...", Revue Economique 1989, p 143) et la conception holiste selon laquelle le comportement des individus n'est intelligible que

réinséré dans le groupe social auquel ils appartiennent (à travers par exemple la notion d'"individu collectif"). La position est ambiguë et, de ce fait, critiquable et critiquée (cf par exemple Defalvard 1992), mais mérite sans doute d'être défendue pour dépasser le clivage individualisme *versus* holisme qui peut parfois paraître stérile pour la compréhension d'une réalité "complexe" (au sens de E. Morin 1991, 1992, R. Delorme 1998...).

L'adoption de l'hypothèse de rationalité procédurale a également des implications implicites sur la façon de concevoir, de poser et de résoudre les problèmes économiques. En mettant l'accent sur l'aspect délibératif de la prise de décision, l'appréhension des comportements individuels à travers l'hypothèse de rationalité procédurale cherche plus à répondre à la question "comment ?" (comment les individus prennent-ils concrètement leurs décisions ?) qu'à la question "pourquoi ?" ("pourquoi ?" au sens de "pour poursuivre quels objectifs ?").

Par ailleurs, dans la conception simonienne de la rationalité, les critères d'appréciation et les motivations de la décision sont *endogènes*, c'est-à-dire relatifs au processus de décision lui-même, et ne s'apprécient pas de l'extérieur mais de l'intérieur du processus de décision. Le critère de vérité du raisonnement de l'agent économique, comme celui du scientifique, l'économiste, qui étudie son comportement, n'est donc pas extérieur ou exogène au raisonnement lui-même : la définition du critère de vérité est donc endogène à un raisonnement qui relève sans doute plus de l'argumentation que de la démonstration (cf Grize 82). L'économiste perd son statut d'expert. La conception et la résolution des problèmes économiques impliquent alors de "*modéliser pour comprendre plutôt que mathématiser pour résoudre*" (Le Moigne 1995, p 151).

Comme nous l'avons déjà évoqué, le statut même de l'hypothèse de rationalité dans le raisonnement scientifique change avec le passage de l'hypothèse de rationalité substantielle à conception simonienne de la rationalité. Dans le premier cas, on adopte une démarche instrumentaliste où l'hypothèse de rationalité n'est qu'un instrument permettant de garantir la logique d'un raisonnement déductif dont seules les implications et les prédictions doivent être confrontées à la réalité (Friedman 1953). Dans le second cas, on privilégie une démarche centrée sur la proximité de l'observateur et de l'observé, qui s'éloigne tout autant d'un instrumentalisme radical, selon lequel la réalité n'a d'existence qu'à travers l'instrument qui sert à l'observer, que du réalisme tout aussi radical selon lequel la réalité existe indépendamment de la connaissance. La réalité, nécessairement complexe, ne peut être que construite...

Pour ces diverses raisons, l'adoption d'une hypothèse de rationalité endogène, et le changement de paradigme que cela implique, conduisent à adopter une démarche méthodologique qui relève plus de l'herméneutique que du raisonnement hypothético-

déductif qui préside à la construction du modèle néo-classique sur la base de l'hypothèse de rationalité substantielle, fut-elle affaiblie (Brochier 1997).

Les enjeux épistémologiques du passage de l'hypothèse de rationalité substantielle à l'hypothèse de rationalité simonienne sont fondamentaux, ce qui justifie sans doute les diverses interprétations de la notion de rationalité limitée qui tentent de dépasser certaines limites de l'hypothèse de rationalité substantielle tout en restant dans le même paradigme. L'hypothèse de rationalité limitée apparaît alors comme le dernier cheval de Troyes du modèle substantiel de la décision rationnelle, qui permettrait de "sauver" le noyau dur du paradigme néo-classique. Quant à l'hypothèse de rationalité procédurale, elle ouvre à l'économiste de nouveaux champs d'analyse et de réflexion qu'il a désormais à parcourir...

BIBLIOGRAPHIE

- BATIFOULIER P., CORDONNIER L. ET ZENOU Y.** (1992). "*L'emprunt de la théorie économique à la tradition sociologique*". Revue Economique, n°5, septembre, p 917-946.
- BEJEAN S. et PEYRON C.** (1997). "*Contrats et conventions : quels apports pour l'économie de la santé ?*" Actes des XVIIèmes Journées de l'Association d'Economie Sociale : "Les avancées théoriques en économie sociale et leurs applications", Dijon, 11-12 septembre 1997, p769-792.
- BROCHIER H.** (1994) "*A propos de l'individualisme méthodologique : l'ouverture d'un débat*". Revue d'Economie Politique, vol.104, n°1, janv-fév., p.25-52.
- BROCHIER H.** (1997). "*Logiques individuelles et logiques collectives*". Colloque "Qu'y a-t-il de nouveau dans la science économique ?", CAESAR-FORUM, Paris, 23-24-25 septembre 1997.
- CAILLE A.** (1989). "*Le don contre l'utilité*". Présentation d'un numéro spécial de la Revue du MAUSS, quatrième trimestre, n°6, p 3-11.
- CHRISTENSEN-SZALANSKI J.** (1984). "*Discount functions and the measurement of patient's values women's decisions during child birth*". Medical decision making, 4, p47-58.
- DEFALVARD H.** (1992). "*Critique de l'individualisme méthodologique revu par l'économie des conventions*". Revue Economique, n°1, janv., p.127-144.
- DELORME R.** (1998 a). "*Agrir en situation complexe*". Communication aux journées de l'ICAD (Institut des Cadres Dirigeants), Paris, 3-5 février 1998.
- DUPUY J.P.** (1989). "*Convention et common knowledge*". Revue Economique, vol 40, n°2, p 361-400.
- FAVEREAU O.** (1989). "*Marchés internes, marchés externes*". Revue Economique, vol 40, n°2, p 273.328.
- FRIEDMAN M.** (1953). "*The methodology of positive economics*". Dans "Essays in positive economics", The University of Chicago Press, Chicago.
- GIORDANO Y.** (1991). "*Décision et organisations : quelles rationalités ?*". Economies et Société, série Sciences de Gestion, n°17, avril, p 161-194.
- GRIZE J.B.** (1982). "*De la logique à l'argumentation*", Genève, Librairie Droz.
- KEYNES J.M.** (1937). "*The general theory of employment*". Quarterly Journal of Economics. : in "Collected writting", tome XIV, 1973.
- KNIGHT F.H.** (1921). "*Risk, uncertainty and profit*". Boston New York, Houghton Mifflin Company.
- LAVILLE F.** (1998). "*Modélisations de la rationalité limitée : de quels outils dispose-t-on ?*" Revue Economique, vol 49, n°2, 1998, p335-365.

- LE MENESTREL M.** (1997) *"Consequential rationalité, procedural rationality, and optimal Nash equilibrium"*. Document de travail INSEAD 97/114/TM.
- LE MOIGNE J.L.** (1995). *"Sur la capacité de la raison à discerner : rationalité substantive et rationalité procédurale, d'Aristote à H. A. Simon, par Descartes et Vico"*. *Le modèle et l'enquête*, Editions de l'EHESS, Paris, p 245-278.
- MAUSS M.** (1985). *"Sociologie et anthropologie"*. Quadrige/PUF.
- MENARD C.** (1989). *"Les organisations en économie de marché"*. *Revue d'Economie Publique*, n°6, p 771-796.
- MIDY F.** (1997) *Qualité de vie et évaluation économique. Des fondements théoriques à la mise en pratique*. Thèse de Doctorat, Université de Bourgogne, octobre 1997, 491p.
- MONGIN P.** (1989). *"Modèle rationnel ou modèle économique de la rationalité ?"*. *Revue Economique*, n°1, p 9-64.
- MORIN E.** (1991) *"De la complexité : Complexus"*. In *"Les théories de la complexité. Autour de l'œuvre d'Henri Atlan"*. Sous la direction de FOGELMAN SOULIÉ F. Editions du seuil, Paris, p.283-296.
- ORLEAN A.** (ed.) (1994). *"Analyse économique des conventions"*. Paris, Presses Universitaires de France.
- ORLEAN A.** (1989). *"Pour une approche cognitive des conventions économiques"*. *Revue Economique*, vol 40, n°2, p 241-272.
- PONSSARD J.P.** (1994). *"Formalisation des connaissances, apprentissage organisationnel et rationalité interactive"*. In ORLEAN A. (ed.) (1994). *"Analyse économique des conventions"*. Paris, Presses Universitaires de France, p169-1988.
- POPPER K.R.** (1963). *"Conjectures et réfutations"*, Trad. franç. de Launais et Launais, Paris, Payot 1985.
- Revue Economique** (1989). *"L'économie des conventions"*, vol.40, n°2.
- SAVAGE L.J.** (1954). *"The foundations of statistics"*. New york, Wiley Publications on Statistics.
- SEN A.** (1977). *"Des idiots rationnels"*. Philosophy and public affairs. Trad. franç. dans *"Ethique et économie"*, Paris, PUF, 1993.
- SIMON H.A.** (1955). *"A behavioural model of rational choice"*. *Quarterly Journal of Economics*, february.
- SIMON H.A.** (1976). *"From substantive to procedural rationality"*. In Latsis ed : *"Method and appraisal in economics"*, Cambridge University Press.
- SIMON H.A.** (1979). *"Rational decision making in business organisation"*. *American Economic Review*, vol 69, n°4, p 493-513.
- SIMON H.A.** (1982). *"Models of Bounded Rationality"*. Cambridge, MIT Press.
- SIMON H.A.** (1983). *"Reason in human affairs"*. Basil Blackwell.

SIMON H.A. (1988). "*Scientific discovery as problem solving*". Peano lecture, Rosselli foundation, Turin. Repris dans Simon H.A. (1992) : "*Economics, bounded rationality and cognitive revolution*". Edward Edgar, England, p.102-119.

SIMON H.A. (1992) "*Economics, bounded rationality and cognitive revolution*". Edward Edgar, England.

SIMON H.A. and SCHAEFFER (1992). "*The game of chess*". In AUMANN et ART (eds) : "*Handbook of game theory*". Amsterdam, Elsevier, p.1-17.

SIMON H.A. (1996). "*The sciences of artificial*". Cambridge, The MIT Press, 3ème édition.

STIGLER G.J. (1961). "*The economics of information*". Journal of Political Economy, 69, p.213-225.

THEVENOT L. (1989). "*Equilibre et irrationnalité dans un univers complexe*". Revue Economique, vol 40, n°2, p 247-197.

VIVIANI J.L. (1994). "*Incertitude et rationalité* Revue Française d'Economie, vol.IX, n°2, printemps 1994.

WALLISER B. (1989). "*Instrumental rationality and cognitive rationality*". Theory and Decision, vol 27.

WILLIAMSON O.E. (1994). "*Les institutions de l'économie*". InterEditions, Paris.

WILLINGER (1996). "*Préférences dépendantes du contexte. Une analyse expérimentale*" Revue Economique, n°3, mai, p 577-587.