

Utilitarisme et welfarisme en économie : discussion critique

Cyril Hédoïn

Séminaire de spécialité “Economie normative et équité”

Master 2 – Parcours recherche 2014-15

Introduction

- L'économie du bien-être est davantage welfariste qu'utilitariste
- L'utilitarisme est une forme particulière de welfarisme qui repose sur l'idée que la **base informationnelle** est large (utilités cardinales + comparaisons interpersonnelles d'utilités)
- Le welfarisme a lui-même été soumis à plusieurs critiques, notamment dans son incapacité à prendre en compte l'importance des droits et de l'autonomie

Plan

- 1) De l'utilitarisme au welfarisme
- 2) Le welfarisme : limites et paradoxes

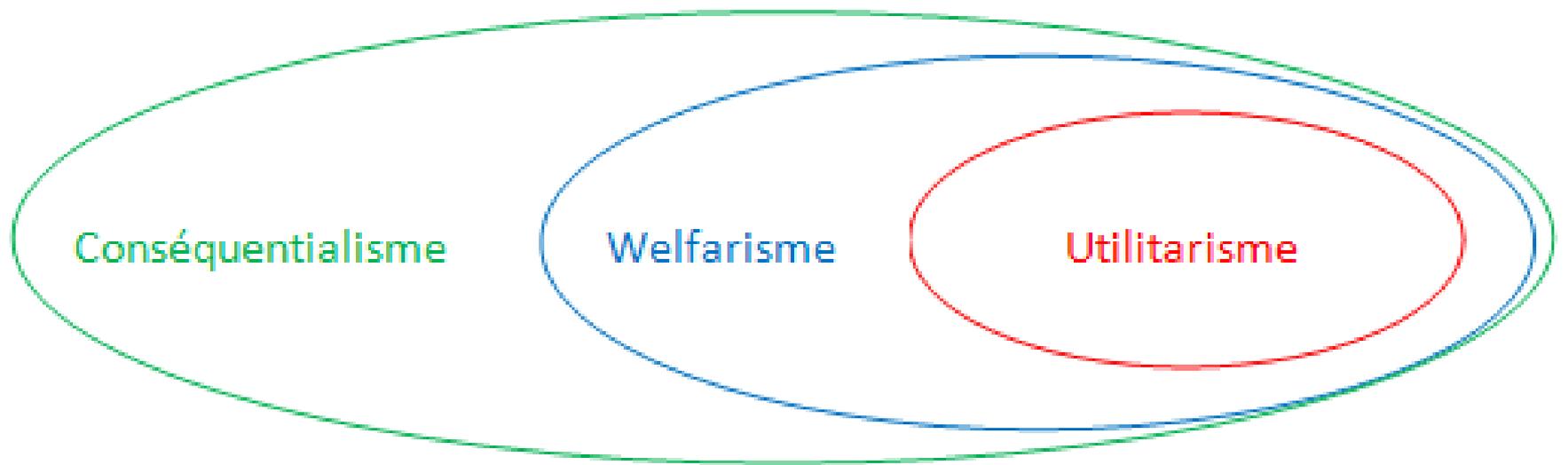
1. De l'utilitarisme au welfarisme

- Selon l'utilitarisme, une alternative sociale A est au moins aussi bonne qu'une alternative sociale B ssi **la somme des utilités individuelles dans A est égale ou supérieure à la somme des utilités individuelles dans B**

$$\sum_i u_i(A) \geq \sum_i u_i(B)$$

- La possibilité de l'utilitarisme repose sur l'existence d'une base **informationnelle large** concernant les préférences des agents :
 - Utilités cardinales
 - Comparaisons interpersonnelles d'utilités
- *A contrario*, l'utilitarisme conduit à ignorer de nombreuses informations :
 - Droits et responsabilité
 - Nombre et identité des alternatives disponibles
 - Distribution des utilités dans la population
 - Etc.

- La « nouvelle » économie du bien-être s'est construite sur un rejet de l'utilitarisme
- Critiques relatives à la base informationnelle :
 - Rejet des utilités cardinales
 - Rejet des comparaisons interpersonnelles d'utilités
- La caractéristique constitutive du welfarisme est la contrainte informationnel qu'il pose à l'évaluation des alternatives sociales (Sen) : **la préférence sociale entre deux alternatives dépend uniquement des utilités individuelles**
- La seule information pertinente est l'information liée aux utilités des individus, i.e. la satisfaction de leurs préférences
- L'utilitarisme est donc une forme particulière de welfarisme ; le welfarisme est une forme spécifique de **conséquentialisme** (i.e. une alternative sociale est préférable à une autre seulement si ses conséquences sont meilleures)



Les critères de Pareto et de Kaldor-Hicks

- Le welfarisme non-utilitariste ne prend en compte que les utilité ordinales et non-comparables interpersonnellement
- Sur quelle base peut-on comparer deux alternatives sociales ?
- Deux critères sont particulièrement utilisés :
 - Le critère de Pareto
 - Le critère de Kaldor-Hicks

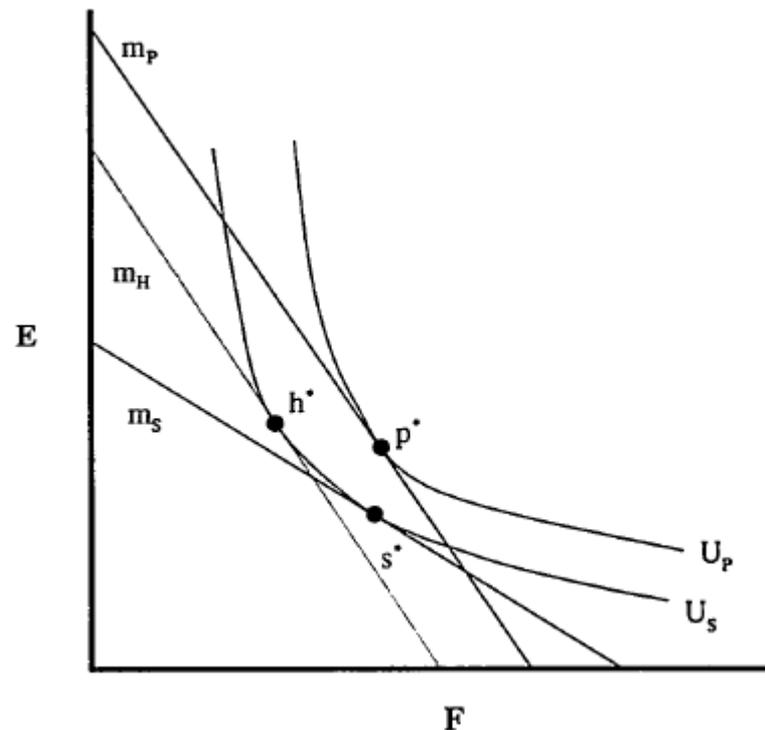
- Le critère de Pareto est un critère d'unanimité qui se décline en plusieurs variantes :
 - Indifférence parétienne : si $\forall i$ et $\forall x, y : u_i(x) = u_i(y)$, alors $U(x) = U(y)$
 - Pareto faible : : si $\forall i$ et $\forall x, y : u_i(x) > u_i(y)$, alors $U(x) > U(y)$
 - Pareto fort : si $\forall i, j$ et $\forall x, y : u_i(x) > u_i(y)$ pour au moins un i et $u_j(x) \geq u_j(y)$ pour $j \neq i$ alors $U(x) > U(y)$

- Le critère de Kaldor-Hicks correspond à un test de compensation : une alternative x est supérieure à une alternative y si ceux qui bénéficient du passage de y à x peuvent (potentiellement) **compenser** ceux qui perdent
- Formellement : x est supérieure à y si on peut atteindre une alternative z à partir d'une redistribution des utilités dans x et telle que z est supérieure à y au sens de Pareto

$$U(x) > U(y) \Leftrightarrow \exists z : [z \in s(x) \ \& \ \forall i, j : u_i(z) > u_i(y) \ \text{et} \\ u_j(x) \geq u_j(y) \ \text{pour } j \neq i]$$

- Attention : le critère de Kaldor-Hicks ne nécessite pas de faire des comparaisons d'utilité mais suppose que les utilités sont transférables en principe

- Le critère de Kaldor-Hicks joue un rôle majeur aujourd'hui dans la mise en œuvre des analyses coût-bénéfice
- En pratique, il repose sur la mesure et l'agrégation des dispositions à payer/accepter des agents



- Le critère de Pareto est généralement considéré comme un critère minimal que doit satisfaire toute doctrine morale ou fonction de bien-être social
- **Parétianisme** : forme faible de welfarisme qui restreint la base informationnelle aux utilités (ordinales et non comparables) lorsqu'il y a unanimité (mais pas nécessairement dans les autres cas)
- Le parétianisme sous-tend de nombreuses propositions d'extension des mécanismes marchands à des domaines traditionnellement « hors-marché » (ex : marché des organes, marché d'un droit à la procréation)

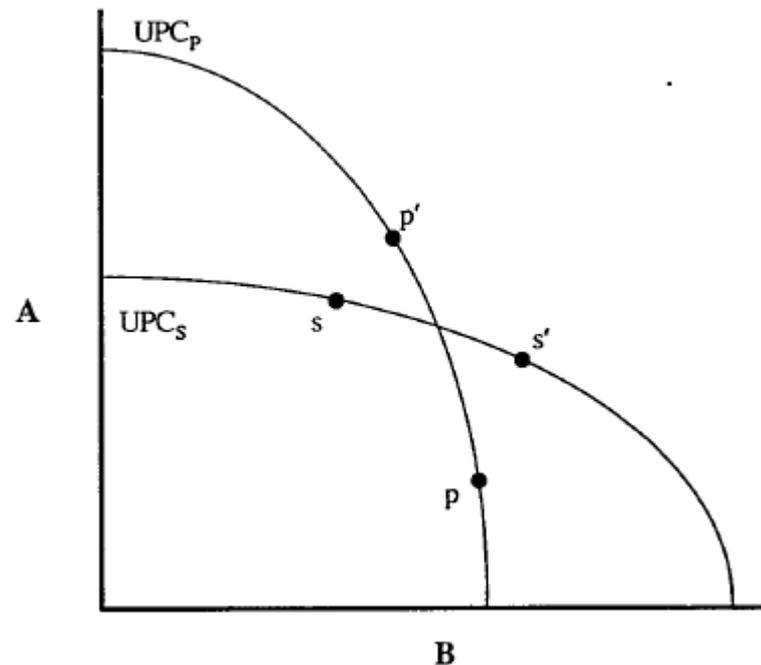
2. Le welfarisme : limites et paradoxes

- L'économie normative dans sa grande majorité est welfariste...
- ... mais le welfarisme a été critiqué depuis de nombreuses décennies par les économistes et les philosophes
- Les critiques portent sur différents points :
 - Critique des critères de Pareto et Kaldor-Hicks
 - Critique du caractère restrictif de la base informationnelle → Impossibilités et paradoxes

Critique des critères de Pareto et Kaldor-Hicks

- La principale limite du critère de Pareto est son **incomplétude**
 - Le critère de Pareto ne permet pas de comparer deux alternatives sociales dès lors qu'il n'y a pas unanimité parmi les membres de la population
- Le critère de Pareto est biaisé en faveur du status quo
- Le critère de Pareto est par ailleurs incompatible avec la prise en compte de toute information autre que les utilités des agents (cf. infra)

- Le critère de Kaldor-Hicks souffre de deux limites majeures :
 - La compensation est seulement potentielle et dans la plupart des cas ne sera jamais effectuée
 - Les effets revenus rendent la relation entre deux alternatives dépendantes du status quo → Paradoxe de Scitovsky



Critique de la base informationnelle : le théorème d'impossibilité d'Arrow

- Une fonction de bien-être sociale arrowienne F détermine un ordre complet de préférences sociales R^* à partir d'un vecteur de préférences individuelles $\{R_i\}$ sur un ensemble X d'alternatives sociales, i.e. $F: \{R_i\} \rightarrow R^*$
 - **Théorème d'impossibilité** : il n'existe pas de fonction F qui satisfait simultanément les 4 conditions suivantes :
 - **U** : F est défini pour tout vecteur $\{R_i\}$ (universalité du domaine)
 - **P** : F respecte le principe faible de Pareto
 - **I** : si deux profils $\{R_i\}$ et $\{R_i'\}$ sont identiques pour deux alternatives x et y , alors $F(\{R_i\})$ et $F(\{R_i'\})$ doivent ordonner x et y de la même manière (indépendance des alternatives non pertinentes)
 - **D** : Il n'y a pas d'individu i tel que pour tous les profils dans le domaine de F et pour toute paire d'alternatives dans X , si $xP_i y$ alors xPy (non-dictature)
- Une fonction F qui satisfait **U**, **P** et **I** est forcément dictatoriale

- Le seul moyen de contourner le théorème d'impossibilité d'Arrow consiste à élargir la base informationnelle
- 2 possibilités sont ouvertes :
 - Elargissement de la base concernant les utilités : utilités cardinales et interpersonnellement comparables
 - Elargissement de la base concernant les alternatives « non pertinentes » : abandon de la condition I
- Formellement, la première solution revient à modifier la définition du concept de fonction de bien-être social au sens d'Arrow...
- ... tandis que la seconde revient à s'écarter du welfarisme au sens strict

Critique de la base informationnelle : le paradoxe Parétien-libéral de Sen

- Le paradoxe parétien-libéral montre la tension entre le parétianisme et le respect de conditions minimales de liberté
- Une **fonction de choix collectif C** détermine là où les alternatives collectivement choisies en fonction de l'ensemble X des alternatives sociales disponibles, i.e. $C: X \rightarrow X$ avec $C(X) \neq \emptyset$ pour tout X
- **Condition de liberté minimale** : chaque individu i est décisif sur un domaine $D_i \subset X$ composé au minimum de 2 alternatives sociales, i.e. $\forall x, y \in D_i$ si $xP_i y$ alors $C(x, y) = x$

- **Paradoxe Parétien-libéral** : aucune fonction de choix collectif C ne satisfait les 3 conditions suivantes
 - **U** (universalité du domaine) : C est défini pour tout profil de préférences individuelles $\{R_i\}$ et pour tout ensemble X
 - **P** : la fonction de choix collectif respecte le principe de Pareto faible, i.e. si $\forall_i xP_iy$, alors $C(x, y) = x$
 - **M** : la fonction de choix collectif respecte la condition de liberté minimale
- Le parétianisme (et donc le welfarisme) ne permet pas de prendre en compte des informations non liées aux utilités

Démonstration

- Soit deux individus (Ann et Bob) et trois alternatives sociales :
 - x = Ann et Bob ne regardent pas « Les anges de la téléréalité »
 - y = Ann regarde « Les anges » et pas Bob
 - z = Bob regarde « Les anges » et pas Ann
- Les préférences de Ann et Bob sont les suivantes :

Ann	Bob
x	y
y	z
z	x

- Ann est décisive sur le domaine $D_{ann} = (x, y)$ et Bob est décisif sur le domaine $D_{Bob} = (x, z)$
 - Or,
 - Le principe de Pareto implique que $C(y, z) = y$
 - La condition de liberté minimale implique que $C(x, z) = z$
 - La condition de liberté minimale implique que $C(x, y) = x$
- Par conséquent $C(x, y, z) = \emptyset$, ce qui est impossible par la définition même d'une fonction de choix collectif