

Théorie micoréconomique

Alan Kirman



Édition électronique

URL : <https://journals.openedition.org/annuaire-ehess/17738>

ISSN : 2431-8698

Éditeur

EHESS - École des hautes études en sciences sociales

Édition imprimée

Date de publication : 1 janvier 2006

Pagination : 553-555

ISSN : 0398-2025

Référence électronique

Alan Kirman, « Théorie micoréconomique », *Annuaire de l'EHESS* [En ligne], | 2006, mis en ligne le 01 avril 2015, consulté le 20 mai 2021. URL : <http://journals.openedition.org/annuaire-ehess/17738>

Ce document a été généré automatiquement le 20 mai 2021.

EHESS

Théorie microréconomique

Alan Kirman

Alan Kirman, *directeur d'études*

- 1 LA préoccupation principale du séminaire est l'analyse du comportement individuel de l'acteur économique et l'agrégation des comportements. Il s'agit de se situer ici au coeur des approches récentes de la recherche concernant la modélisation des marchés et des organisations, d'un point de vue aussi bien théorique qu'empirique. Les approches sont très variées, la théorie des jeux considère comme fondamentale une capacité de calcul et une rationalité totale de la part des agents, d'autres approches considèrent des rationalités plus limitées. Tandis que la théorie des jeux considère, en général, que tous les agents interagissent, d'autres approches mettent l'accent sur l'interaction à travers des réseaux. En particulier, la formation des réseaux et des groupes occupe une position centrale dans les Intérêts du séminaire...
- 2 Les thèmes suivants ont occupé une place importante dans le séminaire
 - Les relations micro-macro relevant de phénomènes d'agrégation et de systèmes d'interactions. La rationalité collective par rapport à la rationalité individuelle.
 - L'hétérogénéité des populations économiques, ceci à travers la dynamique des comportements engendrés par l'impact des interactions directes et Indirectes entre les agents.
 - L'émergence, l'adaptation, la création de coalitions et de réseaux d'acteurs. Il y a deux approches à ce problème. D'abord il y a des modèles théoriques de la formation des coalitions basés sur la théorie des jeux, coopératifs, et non coopératifs. En second lieu, il y a les processus d'apprentissage, d'alliance, de contagion et de coopération entre individus et firmes prenant ici en compte les aspects stratégiques mais attribuant moins de rationalité aux agents.
- 3 Un des thèmes principaux traités concerne l'évolution des marchés et des structures d'échanges. Cet axe de recherche traite de l'émergence des marchés et des structures d'échanges, et de l'analyse positive des institutions de marché existant. Nous avons étudié l'émergence de structures et de groupes sur les marchés. Cette émergence peut être consciente ou le résultat d'un processus d'apprentissage. Nous poursuivons une

voie qui a commencé avec l'étude du marché de gros de poisson de Marseille. Nous prolongeons cette étude avec un examen du MIN des Arnavaux, un marché de gros de fruits et légumes. Plus généralement nous cherchons à démontrer l'impact du type d'organisation d'un marché spécifique sur l'évolution des prix.

- 4 Nous avons aussi commencé à examiner les effets de contagion dans les marchés financiers induits par les réseaux de banques et de fonds d'investissement. Les premiers résultats montrent que la structure de ces réseaux a un impact important sur leur vulnérabilité. Un phénomène souvent observé pour les séries de prix financiers est celui de la « mémoire longue ». Ceci veut dire que certaines caractéristiques statistiques des prix durent plus longtemps que prévu par la théorie standard. Ce problème a été le sujet de deux articles écrits en collaboration avec Gilles Teyssière, et la préparation d'un livre qui va être publié chez Springer, sur la mémoire longue en économie.
- 5 *Les réseaux*. Un autre thème du séminaire concerne la modélisation des relations de confiance sur les marchés sous forme de graphe d'interactions. Un exemple concerne les réseaux d'acheteurs et de vendeurs sur un marché. Sur beaucoup de marchés, les échanges ne sont pas anonymes, et les vendeurs et les acheteurs décident de former des liens entre eux. Nous avons comparé les données du marché de Marseille avec celle d'Ancône en Italie où l'organisation est différente. Nous avons aussi étudié les réseaux de citations dans les revues d'économie et nous avons développé une méthode pour analyser la structure hiérarchique de ces réseaux.
- 6 Nous avons aussi, dans ce contexte examiné la négociation entre vendeurs et acheteurs sur le marché de gros de fruits et légumes de Marseille. Nous disposons de données sur les offres et contre offres qui sont faites avant que les transactions aient lieu et même dans le cas où les négociations échouent. Nous analysons l'évolution des prix en fonction des contre offres et dans le temps. Nous trouvons qu'il y a un changement du pouvoir de négociation pendant la journée. La situation est typiquement celle de l'information asymétrique et, à chaque étape, les partenaires modifient leur idée de la distribution des prix sur le marché en fonction de ce qu'ils observent. Donc la situation est loin d'être la situation classique où les prix de réserve des agents ne sont pas modifiés dans le temps.
- 7 De manière générale, nous mettons l'accent dans ce séminaire sur l'idée que les agents agissent selon des règles de comportement simples, qu'ils modifient au cours du temps en fonction de l'expérience acquise. Cette approche repose sur une combinaison des notions d'apprentissage et de l'évolution des institutions qui gouvernent les interactions entre les agents. Nous pouvons résumer d'une façon simple en disant que l'organisation économique se substitue à la rationalité extrême trouvée dans les modèles standards. La rationalité collective est intrinsèquement différente de celle des individus en économie.

Publications

- Avec R. Schulz, W. Hardie, et A. Werwatz, « Transactions that did not happen and their influence on prices », *Journal of Economic behavior & organization*, 56 (4), 2005, p. 567-591.
- Avec H. Foellmer, et U. Horst, « Equilibria in financial markets with heterogeneous agents : a probabilistic perspective », *Journal of Mathematical economics*, 41 (1-2), 2005, p. 123-155.
- Avec J. Tuinstra, « Bounded rationality, heterogeneity and market dynamics », *Journal of Economic dynamics and control*, 29 (4), 2005, p. 595-600.

- Avec G. Teysiere, « Testing for bubbles and change-points », *Journal of Economic dynamics and control*, 29 (4), 2005, p. 765-799.
 - Avec P. Cohendet et J.-B. Zimmermann, « Émergence, formation et dynamique des réseaux. Modèles de la morphogénèse », *Revue d'économie industrielle*, 103, 2004, p. 15-42.
-

INDEX

Thèmes : Économie