

Fondements d'une théorie positive des choix comportant un risque et critique des postulats et axiomes de l'école américaine, par MAURICE ALLAIS. Une brochure, 10½ po. x 8¼, 55 pages — IMPRIMERIE NATIONALE, Paris, 1955

Roger Dehem

Volume 32, Number 1, April–June 1956

URI: <https://id.erudit.org/iderudit/1002779ar>

DOI: <https://doi.org/10.7202/1002779ar>

[See table of contents](#)

Publisher(s)

HEC Montréal

ISSN

0001-771X (print)

1710-3991 (digital)

[Explore this journal](#)

Cite this review

Dehem, R. (1956). Review of [*Fondements d'une théorie positive des choix comportant un risque et critique des postulats et axiomes de l'école américaine*, par MAURICE ALLAIS. Une brochure, 10½ po. x 8¼, 55 pages — IMPRIMERIE NATIONALE, Paris, 1955]. *L'Actualité économique*, 32(1), 159–159.
<https://doi.org/10.7202/1002779ar>

Fondements d'une théorie positive des choix comportant un risque et critique des postulats et axiomes de l'école américaine, par MAURICE ALLAIS. Une brochure, 10½ po. × 8¼, 55 pages. — IMPRIMERIE NATIONALE, Paris, 1955.

Depuis la parution de la *Theory of Games* de Neumann et Morgenstern, en 1944, la théorie du risque a connu un regain d'intérêt. Les théoriciens les plus puissants, tels Samuelson, Marschak, Savage et Friedman ont tenté de donner une explication du comportement de l'homme réel devant un champ de choix aléatoire et une définition des choix rationnels parmi des éventualités incertaines. Ces auteurs fondent leurs systèmes très rigoureux sur des ensembles d'axiomes qui définissent la rationalité. Or, M. Allais s'en prend violemment à ces axiomes, dont il nie l'évidence.

Le système de M. Allais est fondé sur quatre éléments fondamentaux: 1) la déformation psychologique des valeurs monétaires, en raison de la décroissance de la satisfaction marginale; 2) la déformation subjective des probabilités objectives, en raison de l'ignorance de celles-ci; 3) la pondération des valeurs psychologiques par les probabilités subjectives pour obtenir l'espérance mathématique des valeurs psychologiques; 4) la forme des distributions de probabilités des valeurs psychologiques, en particulier leur dispersion.

M. Allais reproche à ce qu'il appelle l'école américaine de définir axiomatiquement la rationalité de façon à aboutir à la règle de Bernoulli, qui exclut la prise en considération de la dispersion des distributions de probabilité. Il montre que le principe de Bernoulli, qui ne fait prendre en considération que l'espérance mathématique des gains, est un principe de rationalité trop restrictif, qui est infirmé par le comportement d'hommes «dont on a par ailleurs des raisons de penser qu'ils se comportent rationnellement» (p. 32), ou qui ne concorde, en tout cas, pas avec les axiomes de rationalité proposés par Allais. Selon l'auteur un homme est réputé rationnel s'il poursuit des fins cohérentes avec elles-mêmes, et s'il emploie des moyens appropriés aux fins poursuivies. À partir de cette définition, l'auteur démontre qu'un comportement rationnel peut ne pas obéir à la règle de Bernoulli, et que le respect de cette règle peut n'être pas rationnel.

C'est là le cœur de la thèse d'Allais. L'auteur fait montre, une fois de plus, de la grande puissance de pénétration et de la subtilité de son esprit très supérieur. Son exposé est merveilleusement limpide et se lit agréablement malgré l'aridité du sujet. Disons aussi que ses arguments sont convaincants, et devraient avoir décimé les adversaires. Toutefois nous avons le pressentiment que le sujet n'est peut-être pas encore entièrement vidé. Les désaccords sur le principe de rationalité demeurent troublants.

Roger Dehem

Economic Activity Analysis, édité par OSKAR MORGENSTERN. Un vol., 9 po. × 6¼, relié, 554 pages. — JOHN WILEY AND SONS, 440, 4^e avenue, New-York, 1954.

Ce volume est une contribution intéressante à l'étude, actuellement en pleine expansion, de l'analyse de l'activité économique. C'est un ouvrage collectif qui a trait aux structures et aux propriétés mathématiques de plusieurs modèles de