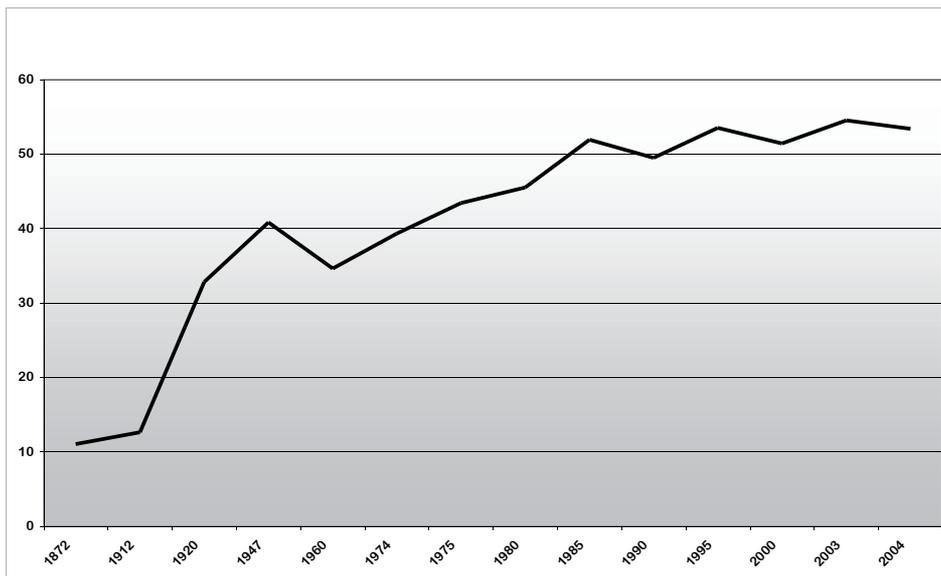


L'intervention de l'État

1

Courbe et croquis

Poids des dépenses de l'État français (en % du PIB)



Sources : Christine André et Robert Delorme, « Le Budget de l'État », *Cahiers français* n° 261 (mai-juin 1993) pour les données historiques, OCDE à partir de 1960.

Les chiffres retenus par l'INSEE dans le cadre de la nouvelle comptabilité nationale issue du SEC 1995 sont légèrement plus élevés (par exemple 52,8 % au lieu de 51,4 % pour l'an 2000).

Questions : quoi – qui ?

I Les fondements empiriques

L'effet de cliquet

Cette notion peut se définir comme le caractère irréversible d'une décision ou d'une évolution. Autrement dit, lorsqu'un phénomène augmente ou diminue, pour une raison quelconque, il restera au même niveau, même lorsque la cause aura disparu. Cela se rapproche de l'effet d'hystérèse.

Appliqué à l'intervention de l'État, on constate, par exemple, que suite à une crise ou à une guerre, les dépenses publiques se maintiennent, après que le facteur déclenchant est terminé.

Loi de Wagner ou loi d'extension croissante de l'activité publique

À la fin du XIX^e siècle, Adolphe Wagner, économiste allemand (1835-1917), établit, dans son ouvrage *Fondement de l'économie politique* (1892), un lien entre le niveau de développement d'un pays et le poids économique et social de l'État. En effet, il montre que « plus la société se civilise, plus l'État est dispendieux ». Plus précisément, l'élasticité des dépenses publiques par rapport au revenu national est supérieure à l'unité. Si l'on a G , la dépense publique, ΔG , la variation de cette dépense publique, Y , le revenu national et ΔY , la variation de ce même revenu, l'élasticité est donnée de la manière suivante :

$$\frac{\frac{\Delta G}{G}}{\frac{\Delta Y}{Y}} > 1$$

Ainsi, si le PIB varie de 1 %, les dépenses publiques vont varier de plus de 1 %.

A. Wagner explique ce phénomène par l'apparition de nouveaux besoins (santé, éducation, culture, etc.), mais surtout par la création d'infrastructures nécessaires à l'organisation et au développement économique et social.

Il semble que la relation mise en évidence par A. Wagner soit vérifiée empiriquement, mais il est excessif de parler de loi.

En outre, Wagner ne précise pas si la hausse des dépenses s'effectue de manière linéaire ou non.

L'effet de déplacement

Peacock et Wiseman (« The Growth of Public Expenditure in The United Kingdom », 1961) tentent de reprendre la question soulevée par la loi de Wagner. Aussi, montrent-ils que les dépenses ne suivent pas un *trend* régulier ou continu, mais adoptent un comportement discret, sautant d'un point à un autre suite à des guerres ou à des crises économiques qui engendrent par exemple une augmentation des dépenses sociales. Une idée sous-jacente à leur théorie est celle de « niveau tolérable de taxation » : les citoyens accepteraient une hausse des prélèvements, puis s'y habitueraient. La puissance publique peut donc maintenir recettes et dépenses, suite à l'apparition de nouveaux postes budgétaires (reconstruction, pensions, etc.).

II Les fondements théoriques

L'école néoclassique et les défaillances de marché (indivisibilités, externalités, biens collectifs)

Dès Adam Smith (1723-1791), l'économie politique est consciente que la « main invisible » connaît des défaillances (*market failures*) qui justifient l'intervention de l'État. En effet, A. Smith expliquait que « le troisième et dernier des devoirs du souverain ou de la République est celui d'élever et d'entretenir ces ouvrages et ces établissements publics dont une grande société retire d'immenses avantages, mais qui sont néanmoins de nature à ne pas pouvoir être entrepris par un ou quelques particuliers, attendu que, pour ceux-ci, le profit ne saurait jamais leur rembourser la dépense » (*Richesse de Nations*, livre V). En termes modernes, certains biens, par nature, sont dits indivisibles, soit du côté de l'offre, soit en ce qui concerne leur usage. Une indivisibilité de l'offre correspond à la situation où le coût fixe est très élevé, et le coût marginal nul. Or dans la théorie néoclassique, à l'équilibre, le prix doit être égal au coût marginal. Ainsi, si le coût marginal est nul, le prix aussi, aucune tarification n'est possible. L'État doit donc prendre en charge la production du bien ou du service. Une indivisibilité de l'offre peut ainsi justifier l'existence d'un monopole naturel. Une indivisibilité d'usage correspond à la situation dans laquelle, on ne peut pas exclure un individu de l'utilisation du produit concerné.

Au début du XX^e siècle, l'économiste anglais Alfred Marshall identifie une autre source d'inefficacité du marché : les externalités ou effets externes. On dit qu'il y a une externalité quand les activités individuelles ont des répercussions, non voulues et non prises en charge par le système de prix, sur les autres agents qui voient par là même leur fonction de production ou de consommation se modifier. Une externalité peut être positive, c'est-à-dire que la valeur sociale d'une action individuelle sera supérieure à sa valeur privée. L'émetteur d'une telle externalité ne sera pas rémunéré et choisira un niveau d'activité sous-optimal. À l'inverse, dans le cas d'une externalité négative, l'agent émetteur aura une activité supérieure à celle socialement souhaitable, car il n'a pas à en supporter les coûts.

En présence d'externalité, il faut internaliser ces effets. Dans les années 1920, A. C. Pigou a proposé une taxe sur les émetteurs d'externalités négatives (principe pollueur-payeur). Une autre manière d'internaliser consiste en la mise en place de normes, de règlements.

Sur une période plus récente, les théoriciens de la croissance endogène s'intéressent aussi aux externalités positives (santé, éducation...) qui peuvent être sources de croissance économique.

Enfin, l'intervention de l'État peut être nécessaire en présence de biens collectifs, c'est-à-dire de biens qui peuvent être consommés simultanément par plusieurs personnes. Ainsi, ce type de bien est caractérisé par, d'une part, la non-rivalité, c'est-à-dire qu'il existe une indivisibilité d'usage, dans le sens où la consommation par un agent ne réduit pas les possibilités d'usage pour les autres et, d'autre part, par la non-exclusion, c'est-à-dire que l'on ne peut pas empêcher un individu d'utiliser ce bien public ; il peut donc adopter un comportement de passager clandestin. Ces deux caractéristiques s'attachent à des biens collectifs « purs », mais il existe une gradation en fonction de la force de ces deux critères.

Pour résumer, l'intervention de l'État est justifiée par les économistes néoclassiques par le fait que le fonctionnement naturel des marchés ne permet pas d'atteindre une situation Pareto-optimale.

Les Keynésiens et l'intervention de l'État

Si les néoclassiques centrent leur analyse et donc leurs conclusions au niveau microéconomique, mais ils s'intéressent avant tout au domaine de l'allocation des ressources. Pourtant, les défaillances du marché sont également visibles au niveau macroéconomique.

Ainsi, John Maynard Keynes montre que les mécanismes du marché ne permettent pas de coordonner efficacement les comportements, conduisant par là même à des sous-optimalités comme l'équilibre de sous-emploi. En effet, J. M. Keynes, dans la *Théorie générale de l'emploi, de l'intérêt et de la monnaie* (1936) identifie essentiellement deux causes à ce phénomène. Le premier facteur est passé à la postérité à travers l'expression de Keynes, « les esprits animaux » (*Théorie générale*), qui exprime le fait que les individus ne raisonnent pas en termes probabilistes, comme le pensent les néoclassiques, mais dans un environnement baigné d'une incertitude radicale qui conduit les agents économiques à osciller entre des phases d'euphorie et de pessimisme qui perturbent les relations et l'activité économiques.

Le second facteur relève de la présence de rigidités nominales. Plus précisément, Keynes prend le contre-pied des néoclassiques en réfutant la flexibilité des prix ; au contraire, peu flexibles, les prix et les salaires ne permettent pas d'ajuster l'offre et la demande sur les marchés. Il en résulte des fluctuations de l'activité économique qu'il faut gommer par des politiques contracycliques.

La Nouvelle École Classique (NEC) ou le rejet de la politique économique

L'influence de la NEC est perceptible à partir des années 1970. En effet, R. Lucas dans son article intitulé « Expectations and the Neutrality of Money » (*Journal of Economic Theory*, avril 1972) utilise pour la première fois l'hypothèse des anticipations rationnelles, formulée par J. Muth en 1961. Cette première hypothèse caractéristique de la NEC est complétée par deux autres : l'ajustement continu des marchés et l'hypothèse de l'offre globale.

Les anticipations rationnelles correspondent à la situation dans laquelle les individus effectuent des prévisions en utilisant au mieux toute l'information (passée et actuelle) disponible à partir d'un modèle interprétatif correct de l'économie. Ainsi, aucun écart n'apparaît entre les prévisions des agents et celles réalisées par les économistes, à une variable aléatoire près, qui prend corps dans un effet de surprise.

L'hypothèse d'ajustement continu des marchés est plus classique : offre et demande s'ajustent en fonction d'une variable flexible, en l'occurrence les prix, pour atteindre l'équilibre.

L'hypothèse d'offre globale explique, quant à elle, que les producteurs et les travailleurs modifient leur offre de produit et de travail quand ils sont surpris par un écart entre la valeur anticipée des prix ou des salaires et celle observée.

L'ensemble de ces hypothèses a des implications importantes en matière de politique économique, ces dernières devenant inefficaces, puisque les agents, soit prendront en compte dans leurs anticipations les effets attendus de l'action gouvernementale, soit, s'ils sont surpris, réajusteront leur position pour revenir à la situation d'équilibre.

En outre, les agents étant rationnels, ils se méfient des politiques discrétionnaires qui peuvent sans cesse être révisées, au gré des échéances électorales par exemple. Discréditées, les politiques économiques mises en œuvre ne provoqueront pas de modification des anticipations. On retrouve ici la thématique de la crédibilité et d'incohérence intertemporelle développée par Kydland et Prescott.

Enfin, R. Lucas, en 1976, montre que l'évaluation des politiques économiques à travers les modèles macro-économétriques est impossible. En effet, ces modèles supposent des paramètres invariables en fonction des événements observés dans le passé, alors que la mise en application de mesures étatiques les fait évoluer, car les nouvelles informations ont été intégrées par les agents rationnels maximisateurs.

La Nouvelle École Keynésienne (NEK), un interventionnisme prudent

Ce courant se développe dans les années 1970, mais la dénomination n'apparaît que dans les années 1980, pour répondre aux critiques adressées aux modèles keynésiens de la synthèse (modèle IS-LM). En effet, ces derniers postulent les rigidités ; les théoriciens de la NEK se proposent de les expliquer.

Ce courant est dit « keynésien » dans la mesure où il reprend les grands préceptes keynésiens : monnaie non neutre et existence de rigidités nominales qui empêchent la réalisation de l'équilibre ; on lui applique le qualificatif de « nouveau », car ils donnent des fondements microéconomiques à la macroéconomie en utilisant des outils issus de la théorie microéconomique et le concept de rationalité.

Les développements s'appuient sur l'idée que l'information est imparfaite et que les marchés sont incomplets. Ainsi, les diverses imperfections du marché, tout comme les perturbations d'origine monétaire, provoquent des cycles économiques qui nécessitent une intervention de l'État. Par contre, les nouveaux keynésiens restent prudents : les politiques économiques sont particulièrement nécessaires dans le cas de crises profondes, car les ajustements sont trop lents. Cependant, l'intervention de l'État doit rester souple, d'autant que nombre de paramètres influent sur leur efficacité.

Faits et problématique

Le développement de l'État depuis la Révolution industrielle

L'intervention de l'État dans l'économie n'est pas une nouveauté apparue au XIX^e siècle. En effet, dès la Renaissance, le courant mercantiliste prône l'enrichissement de la nation et le commerce, allant ainsi à l'encontre des valeurs propres au Moyen-Âge. L'enrichissement passe par l'accumulation de métaux précieux, dont l'acquisition se fait par divers moyens : le commerce pour les mercantilistes anglais, l'industrie pour la version française, l'interdiction de sortie de métaux en Espagne ou au Portugal...

Les préceptes mercantilistes ont créé un terreau favorable au développement de l'activité économique qui a débouché ensuite sur la première révolution industrielle. Ainsi, il a permis la mise en place des « conditions préalables au développement » selon WW. Rostow qui permettent de passer les limites de l'économie traditionnelle. L'intervention de l'État (colbertisme par exemple) a consisté à organiser, stimuler et protéger les activités industrielles favorisant ainsi l'expansion commerciale et monétaire, et par là même l'initiative privée, principe de base du capitalisme et du libéralisme économique.

Ainsi, même si la pensée libérale s'est peu à peu répandue, l'État a tout de même contribué à l'essor économique de la fin du XVIII^e siècle et du XIX^e siècle. À l'issue des deux guerres mondiales, la place de l'État dans l'économie a été plus importante, et ses missions ont évolué. Toutefois, la crise des années 1970 a mis en lumière sa relative incapacité à résoudre les difficultés économiques des pays développés, ce qui a conduit à une réflexion sur de nouveaux *modus operandi* de l'interventionnisme étatique, ainsi qu'à une redéfinition de son périmètre.

I La montée de l'intervention de l'État

A • De la première à la seconde Révolution industrielle

L'intervention de l'État dans l'économie aux XVIII^e et XIX^e siècles a connu des évolutions, et n'a pas revêtu la même ampleur ni la même nature selon les pays.

Pour un premier groupe de pays, constitué principalement de l'Angleterre et de la France, l'État a contribué à créer un environnement favorable à l'activité économique.

Aucune politique structurelle, ni même conjoncturelle n'est menée pour soutenir l'activité économique ou donner des impulsions afin de développer le pays. L'État se contente d'assumer ses fonctions régaliennes, c'est-à-dire, à l'origine, attachées à l'autorité royale :

- la diplomatie (prévention) et l'armée (en cas de conflit) pour veiller à la sécurité extérieure ;
- la police, qui assure la sécurité publique intérieure ;
- la justice qui tranche les différends et interprète le droit ;
- l'émission de la monnaie, notamment par le biais d'une Banque centrale.

En définitive, ces fonctions non économiques ont des répercussions sur l'activité : par exemple, les dépenses militaires qui représentaient une part importante du budget français avaient un effet d'entraînement sur les industries qui y étaient liées (armement, textile, construction, alimentation...).

Si la révolution industrielle est le fruit de réactions en chaîne intrasectorielles, mais aussi intersectorielles, il serait toutefois faux de penser que l'État n'est pas intervenu. En effet, la théorie libérale, même si elle soutient l'idée d'un État-gendarme limité à ses seules fonctions régaliennes, n'interdit pas une action sur l'environnement économique général. En effet, suite aux imprécations des physiocrates, puis des économistes classiques, l'État doit lever toutes les entraves au bon fonctionnement des marchés, et donc briser toutes les anciennes structures et solidarités d'ancien régime. En d'autres termes, il participe au mouvement de « désencastrement » de l'économie du social, selon l'expression de K. Polanyi. L'exemple de la création du marché du travail est emblématique de ce processus. Différentes mesures sont ainsi prises pour garantir le libre jeu des marchés et la concurrence, pour protéger la propriété privée et garantir les contrats. En outre, même ouvertement favorables au libre-échange, ces pays du « *early start* », et surtout la France, sont protectionnistes. Toutefois, au milieu d'un XIX^e siècle globalement protectionniste, le libre-échange marque quelques points (loi sur les blés en Angleterre en 1846, tarifs Méline en France en 1860...).

L'Allemagne, la Belgique ou la Russie ont enclenché leur révolution industrielle bien plus tard dans la seconde moitié du XIX^e siècle et bien souvent sous l'impulsion de l'État.

Pour les pays dits à industrialisation tardive (late comers), le développement économique fait l'objet d'une stratégie élaborée par les gouvernements. Toutefois, les modalités de l'intervention étatique ont varié d'un pays à l'autre. On peut distinguer deux sous-groupes.

Aux États-Unis et en Allemagne, l'action de l'État a été modérée. L'initiative privée, principal moteur de la croissance et du développement, a été encouragée, mais aussi encadrée par les États qui ont tenté de créer un environnement favorable à l'activité économique. La tradition allemande est plus interventionniste, même si elle reste relativement diffuse et mesurée. Dès 1834, avec la réalisation de l'union économique de 25 pays germaniques, le *Zollverein*, les industries naissantes sont, en application des théories de F. List, protégées des concurrents étrangers, tout en bénéficiant d'un marché potentiellement plus vaste. L'État allemand, surtout sous la chancellerie de Otto von Bismarck entre 1862 et 1890, encourage la création des chemins de fer, les transferts de technologie ou l'éducation ou encore la concentration industrielles avec la création des *Konzern*, et jette également les bases d'un système de protection sociale.

Les gouvernements états-uniens ont, quant à eux, longtemps été protectionnistes pour les mêmes raisons qu'en Allemagne. Ainsi, sur le plan intérieur, l'État a-t-il également organisé, subventionné la création d'infrastructures ferroviaires, la création d'entreprises d'économie mixte, tout en veillant à ne pas étouffer l'initiative privée vivifiée par la conquête de nouveaux territoires et l'immigration (cf. Robert Fogel et Douglas North sur le rôle de la matrice institutionnelle).

Le second sous-groupe est constitué de la Russie et du Japon qui ont connu un interventionnisme plus marqué et décisif pour le démarrage économique. En effet, avec l'ouverture de l'ère Meiji en 1868, l'État japonais intervient massivement à travers une « politique d'environnement », (éducation, transferts de technologie...), ainsi qu'à travers la création de nombreuses entreprises dans des secteurs d'activité variés, qui seront par la suite rétrocédées à des acteurs privés pour constituer les puissants *zaibatsu* (Mitsui, Mitsubishi, Sumitomo et Yasuda).

La Russie, pendant la première moitié du XIX^e siècle, est caractérisée par une immixtion relativement modeste de l'État dans l'économie. Ce n'est qu'à partir de 1870 et l'effondrement des revenus agricoles, que le pouvoir politique prend en main l'industrialisation du pays, quasiment à marche forcée. Comme dans les cas précédents, l'intervention publique prend la forme d'une politique protectionniste, accompagnée de la création d'infrastructures financée soit par des emprunts à l'étranger (les fameux emprunts russes), soit par une épargne forcée dégagée par la pression fiscale qui écrase la paysannerie.

Globalement, hormis en Russie, l'interventionnisme étatique sera marqué du sceau du libéralisme, mais l'entrée en guerre de l'Europe va modifier la donne.

B • L'État : de la Première à la Seconde Guerre mondiale

Au sortir du grand XIX^e siècle, la première Guerre mondiale rompt l'ordre économique libéral qui avait prévalu jusqu'alors.