

De la performativité à la réflexivité

David Stark
Columbia University
Notes prises par **Hervé Dumez**

DANS UN SÉMINAIRE
QUI S'EST TENU AU
CENTRE DE
SOCIOLOGIE DES
ORGANISATIONS
LE 19 OCTOBRE 2012,
DAVID STARK A
PRÉSENTÉ UNE
RECHERCHE À
PROPOS DE LA VISION
LATÉRALE SUR LES
MARCHÉS
FINANCIERS.

Position du problème

Les origines de la sociologie économique remontent à Parsons, et à ce qu'on pourrait appeler le « pacte parsonien » : vous, les économistes, vous vous intéressez à la valeur, et nous, sociologues, nous nous intéressons aux valeurs. Nous allons étudier les relations sociales dans lesquelles les faits économiques sont encastrés (*embedded*).

Aujourd'hui, deux approches dominent la sociologie économique. L'une s'intéresse à la manière dont les économies sont encastrées dans les valeurs culturelles et les cadres cognitifs. L'autre regarde comment les économies sont encastrées dans les relations sociales. Les deux approches font l'impasse sur les pratiques de calcul (*calculative practice*).

Et puis les *Science and Technology Studies* sont arrivées dans le champ avec Michel Callon, Donald McKenzie et Karin Knorr-Cetina. L'idée de ces auteurs est que la sociologie n'est pas celle des êtres humains (*human beings*) mais celle de l'être humain (le *being human*). Si on fait de l'analyse de réseau, on ne voit pas que des humains : le calcul est distribué entre des humains et des non humains.

L'objet que se fixe le présent travail est de réintroduire la réflexivité en conservant la base matérielle de l'analyse.

Repartons de la performativité.

Les modèles financiers ne sont pas des représentations. Ils constituent des interventions qui formatent et « performant » les marchés. C'est l'idée de Donald McKenzie. Le modèle est à la fois une carte et un outil prédictif. Ce n'est pas le modèle qui performe l'économie, c'est son usage. Et la performativité dépend du caractère prédictif du modèle via l'usage qu'on en fait.

La définition que j'ai choisi d'en donner est alors : un modèle est performatif quand son usage accroît ses capacités prédictives. L'objectif théorique consiste donc à passer de la performativité à la réflexivité.

L'institutionnalisme dans la sociologie économique se concentre sur les routines, les *scripts*, ce qui est tenu pour acquis, et sur l'action non réflexive. De mon point de vue, la performativité ignore la compétence d'expert (*skilled performance*).

Pourquoi devrions-nous dénier aux acteurs la réflexivité que nous valorisons dans notre profession de chercheur ?

La clef, si nous voulons comprendre la cognition distribuée et la réflexivité distribuée est une nouvelle forme de socialité. Elle est désencastrée quoique enchevêtrée,

anonyme quoique collective, médiatisée par des écrans et pourtant différenciée, impersonnelle quoique profondément sociale (*disembedded yet entangled, anonymous yet collective, screen-mediated yet differentiated, impersonal yet emphatically social*).

Le travail qui est ici présenté part de deux recherches précédentes, l'une menée avec Daniel Beunza, l'autre avec Matteo Pratto.

La recherche avec Daniel Beunza

Elle a été menée à Wall Street dans une salle détruite le 11 septembre (Beunza & Stark, 2012). Notre question de départ était : comment les traders gèrent-ils la question de la faillibilité de leurs modèles, le fait que les modèles peuvent se tromper ? Cette question n'avait pas été traitée jusque-là. À la différence des économistes, les traders sont conscients de la faillibilité de leurs modèles. Tout modèle est imparfait. Si vous n'en avez pas conscience, vous risquez de perdre votre chemise. Il faut donc faire confiance aux modèles tout en étant conscients qu'ils peuvent se tromper. Comment les traders gèrent-ils cette situation ? On peut faire la relation avec « Ceci n'est pas une pipe ». C'est une pipe en un sens, en tant que représentation d'une pipe, et pourtant pas une pipe, puisqu'il s'agit d'une simple représentation.

Une salle de marché est peuplée de dispositifs ayant pour objet de créer le doute (*devices for doubt*). Les traders n'utilisent pas seulement des modèles et des dispositifs qui performent le marché. Ils créent et utilisent des modèles réflexifs. Cette réflexivité n'est pas extérieure aux structures de calcul socialement distribué, elle est partie intégrante de ces structures. L'arbitrage est une compétence d'expert réflexive et cette réflexivité est collective. En réalité, la compétence en matière de calcul articule deux types dissonants de probabilité. Le premier est celui du poste de travail qui utilise les modèles propres, des bases de données et de l'instrumentation. Le second est la probabilité dérivée, venant de l'extérieur. Si vous tenez pour garantis les résultats des modèles, le risque est d'y laisser sa chemise. Pour gérer ce risque, les traders se tournent vers des réseaux socio-techniques extérieurs à la salle de marché. Il y a donc les écrans, et ce qu'il y a ailleurs, sous la forme d'un réseau sociotechnique. Sur l'écran, il y a un sous écran qui donne des fourchettes (*spread plot*). On voit la position du poste de travail par rapport au *spread* sur le marché. Le *spread plot* établit la diversité des positions dispersées. Donc, le trader a une idée de la dissonance entre lui et les autres (sur la dissonance, voir Stark, 2009). Ceci incite à une nouvelle investigation. La réflexivité ne vient donc pas de la conscience que les

modèles sont imparfaits, elle s'appuie sur une nouvelle forme de socialité qui passe par des dispositifs. Mais attention. Dans les cas où il y a peu de diversité, les dispositifs de dissonance deviennent des dispositifs d'un excès de confiance. La résonance bloque toute réflexivité et peut conduire à des désastres collectifs. La puissance de la modélisation réflexive est qu'elle est fondée sur l'indépendance d'acteurs anonymes dispersés. Mais s'il y a convergence, le risque de désastre collectif est réel.



Mozart, manuscrit autographe du quatuor K. 465
dit « quatuor des dissonances »

La recherche avec Matteo Pratto : de la cognition catégorielle à la cognition perspective

La vue dominante dans la finance réduit la cognition à de la catégorisation. On compare l'objet à une catégorie idéale, et il y a pénalisation automatique si l'on constate un désajustement entre les deux (*mismatch*). C'est ainsi que Zuckerman (1999, 2004) analyse les choses. Cela vient de l'écologie des populations. On sait par contre que l'innovation rentre mal dans les catégories, et qu'elle peut conduire à des pénalités mais aussi à des retours très importants. La cognition distribuée fonctionne en réalité dans un réseau à deux modalités : la première est le fait que l'établissement de la valeur (*valuation*) prend place au niveau d'une place de calcul ; la seconde renvoie aux autres objets. En effet, avant tout dispositif, avant toute catégorie, il y a la question de l'arrière-plan sur lequel se détache un objet. Lorsque je vois un objet se détachant sur un arrière-fond et que je vois le même objet se détachant sur un autre arrière-fond, ce n'est pas le même objet que je vois. C'est une idée très simple, mais très puissante. On focalise quand on situe un objet. Le premier point est la location et l'allocation (*focus – locate an object by allocating attention*). Il faut alors combiner cette idée avec une autre, qui est l'inter-objectivité. Il s'agit d'exploiter les liens de réseau qui se créent quand de multiples agents allouent leur attention à de multiples objets. C'est-à-dire qu'il s'agit d'étudier la vision latérale sociale (*social peripheral vision*). La détermination de la valeur (*valuation*) est alors conçue comme perspectiviste (*perspectival*).

La structure bimodale d'un réseau d'attention (agents et objets) est un espace de calcul. Ma perception d'une valeur (*asset*) est formatée par votre perception et par les différents points de vue sur les autres valeurs. En réalité, votre vision latérale peut affecter ma focalisation. Prenons un exemple emprunté au monde de la recherche. Supposons que j'aie avec un collègue dans un colloque et que nous assistions tous les deux exactement aux mêmes présentations. Nous avons toute chance d'évaluer la qualité de ces présentations de la même manière. Par contre, supposons qu'un autre chercheur ait assisté à une présentation à laquelle nous avons assisté, mais en ayant quant à lui assisté à d'autres présentations. L'évaluation qu'il fera de cette présentation a toute chance d'être très différente de celle que nous ferons, mon collègue et moi.

L'étude menée avec Matteo Pratto a porté sur 8.000 analystes, sur 15.000 firmes et plusieurs millions d'observations analyste-entreprise. L'idée est celle qui a été formulée : un agent interprète une situation par rapport à un portefeuille de situations qu'il a dans son champ de vision. Si l'on adopte cette conception, on peut alors formuler une première hypothèse :

H1 : Au plus on modifie le portefeuille de situations d'arrière-plan, au plus le processus d'évaluation va être changeant.

H2 : Au plus les portefeuilles de situations d'arrière-plan sont similaires, au plus les évaluations focales de deux acteurs seront similaires.

Si l'on admet que les agents sont influencés par leur vision latérale, alors on peut s'attendre à ce que :

H3 : Au plus (au moins) deux acteurs ont rencontré les mêmes situations, au plus leur interprétation d'une situation nouvelle va converger (ou diverger).

H4 : Cette convergence (ou cette divergence) sera d'autant plus grande que ces deux agents auront été confrontés aux évaluations des mêmes tiers.

Références

- Beunza Daniel & Stark David (2012) “From dissonance to resonance: Cognitive interdependence in quantitative Finance”, *Economy and Society*, vol. 41, n° 3, pp. 383-417.
- Clark Andy (2010) *Supersizing the Mind: Embodiment, Action, and Cognitive Extension (Philosophy of Mind)*, Oxford, Oxford University Press.
- Knorr-Cetina Karin & Preda Alex (2005) *The sociology of financial markets*, Oxford, Oxford University Press.
- MacKenzie, Donald, Fabian Muniesa & Lucia Siu [eds] (2007) *Do economists make markets? On the Performativity of Economics*, Princeton, Princeton University Press.
- Stark David (2009) *The Sense of Dissonance: Accounts of Worth in Economic Life*, Princeton, Princeton University Press.
- Zuckerman Ezra W. (1999) “Securities Analysts and the Illegitimacy Discount”, *American Journal of Sociology*, vol. 104, n° 5, pp. 1398-1438.
- Zuckerman Ezra W. (2004) “Structural incoherence and stock market activity”, *American Sociological Review*, vol. 69, n° 3, pp. 405-432 ■



Weimar, statue de Shakespeare
 (Remontant de l'Ilm, au détour d'un bosquet, le promeneur tombe sur Shakespeare qui semble l'avoir entendu venir et guetter son apparition, surpris dans ses pensées, un pied négligemment posé sur le crâne de Yorick)