

Les crises économiques et les statistiques, de 1880 à 2010



Alain Desrosières / Membre de l'Institut National de la Statistique et des Etudes Economiques (INSEE) / August 30th, 2010

[bubbles and crises](#) [national research policy](#)

Les grandes crises sont bien sûr des moments où les statistiques sont intensément mobilisées pour exprimer la gravité de la situation. Mais elles sont aussi des moments de grands débats, lors desquels le rôle de l'Etat dans la régulation et le pilotage de l'économie est profondément repensé. A chacune de ces crises correspond l'émergence de façons nouvelles de quantifier le monde social. De nouveaux modèles d'action impliquent de nouvelles variables et de nouveaux systèmes d'observation.

L'histoire économique et politique des années 1880 à nos jours offre au moins trois (sinon quatre) exemples de telles configurations, associant une façon de penser la société, des façons d'agir sur elle, et des statistiques adaptées à ces situations. La crise des années 1880 a suscité la grande statistique du travail et de l'emploi. Celle de 1929 a été à l'origine des politiques macroéconomiques keynésiennes et de la comptabilité nationale. La crise des années 1970 a été pensée dans les catégories néolibérales de la microéconomie, et a induit des réformes de l'État centrées notamment sur des indicateurs de performances. Enfin, les deux crises, écologique puis financière, des années 2000 seront peut-être à l'origine de façons radicalement nouvelles de penser et de quantifier l'action publique. Un rappel des façons dont quelques crises plus ou moins anciennes ont été vécues, et de leurs conséquences sur les usages des statistiques publiques, peut être utile pour réfléchir à l'ampleur des transformations qui peuvent résulter de ces deux crises récentes.

1880-1930 : statistiques du travail et analyse des cycles économiques

Au 19^{ème} siècle, la pensée libérale dominante dans les pays qui commencent à s'industrialiser implique que l'État doit intervenir le moins possible dans le fonctionnement des marchés. Une exception (mais elle est de taille) : le commerce extérieur. Les débats font rage entre libre-échangistes et protectionnistes. En dehors des anciennes statistiques régaliennes de population, qui remontent au 18^{ème} siècle, les seules statistiques importantes sont celles des importations et des exportations.

Tout change avec la grave crise des années 1870-1880. Celle-ci est pensée à partir de ses conséquences en termes de pauvreté et de chômage. Parmi tous les marchés que la pensée économique libérale suppose capable de s'équilibrer spontanément, il en est un qui, décidément, est différent des autres, celui du travail. Dans les grands pays nouvellement industrialisés (Grande-Bretagne, États-Unis, Allemagne, France, pays

nordiques), des réformateurs sociaux imaginent des législations visant à protéger les travailleurs. Le droit du travail apparaît alors, ainsi que les premières formes d'État Providence, par exemple en Allemagne avec le système dit « bismarckien » d'assurances sociales, qui est fondé sur des cotisations versées par les employeurs et les salariés. La statistique publique se transforme pour répondre à ces nouveaux besoins. En France, un Office du Travail est créé en 1891, auquel est rattachée la Statistique générale de la France (SGF), l'ancêtre de l'INSEE. Cet Office lance de grandes enquêtes sur l'emploi et les salaires. L'ancien Recensement de population est profondément transformé en 1896 par Lucien March, pour s'ouvrir à des questions sur les activités professionnelles et sur le chômage. Par ailleurs, le souci de protéger les salaires ouvriers contre les hausses des prix des biens de consommation suscite la mise en place d'indices de prix, et l'organisation des premières enquêtes sur les budgets des familles ouvrières.

Les méthodologies statistiques elles-mêmes évoluent, en relation avec ces nouvelles politiques. Ainsi, la méthode des sondages probabilistes, déjà imaginée par Laplace au 18ème siècle, mais considérée comme peu rigoureuse tout au long du 19ème, connaît un regain au début du 20ème, pour permettre le lancement d'enquêtes sociales sur les revenus et la pauvreté, notamment en Norvège puis en Grande-Bretagne: pour étayer des politiques sociales. De leur côté, des outils comme la corrélation et la régression, (imaginés par Francis Galton et Karl Pearson dans années 1880-1890 pour outiller des politiques eugénistes aujourd'hui totalement discréditées), sont utilisés par des économistes, comme le Français Marcel Lenoir, dès 1913, pour modéliser les crises cycliques.

L'étude des cycles et le souci de prévoir la survenue des crises ont suscité de nombreux travaux dans les années 1920. Des « bureaux de conjoncture » ont été créés dans divers pays. Aux États-Unis, le « baromètre de Harvard » analysait les décalages temporels entre les variations de certaines grandeurs économiques, et cherchait à découvrir celles (par exemple les commandes de cartons d'emballage) dont ces variations seraient annonciatrices de crise. Malheureusement, ce baromètre échoua à anticiper le krach d'octobre 1929. Cette méthode sombra, pour laisser place, plus tard, aux enquêtes de conjoncture, (qui sont des enquêtes d'opinion) auprès des chefs d'entreprise, puis à des modélisations économétriques plus sophistiquées.

1930-1975 : politiques keynésiennes et comptabilité nationale

La crise de 1929, qui s'étend jusqu'à la fin des années 1930, a été pensée en termes nouveaux par rapport à la précédente. Cette fois, c'est l'équilibre global, entre l'offre et la demande de tous les marchés, qui est mis en cause notamment par Keynes, (sans pour autant que soit préconisée une direction centrale de l'économie, alors expérimentée en URSS). L'équilibre ou le déséquilibre sont symbolisés par « l'équation keynésienne » :

$$\text{Production} + \text{importation} = \text{Consommation} + \text{investissement} + \text{dépense gouvernementale} + \text{exportation}$$

Cette façon de formuler la question impliquait de faire jouer un rôle clé aux dépenses gouvernementales (auparavant absentes des analyses des économistes), grâce au « multiplicateur keynésien ». Des politiques, par ailleurs fort différentes, sont conduites, qui ont pour effet de relancer de cette façon la demande. Ce sont les grands travaux publics lancés aux États-Unis par Roosevelt, ou les fabrications d'armement organisées en Allemagne par les nazis. Par ailleurs, la modélisation macroéconométrique, visant à orienter l'action publique, naît alors, en Norvège avec Ragnar Frisch, et aux Pays-Bas

avec Jan Tinbergen. Ces politiques et ces modèles impliquent une mise en forme et une description radicalement nouvelles de l'ensemble des flux économiques monétaires circulant entre l'ensemble des agents : ce sera la comptabilité nationale, centrée sur les notions de revenu national, de produit intérieur brut (PIB), de consommation des ménages, de formation brute de capital fixe (l'investissement), d'épargne et de besoin de financement.

Aux États Unis la crise frappe particulièrement le monde paysan (crise de mévente) et le monde ouvrier (chômage). Le New Deal implique des politiques fédérales de régulation des marchés agricoles, et de soutien aux chômeurs, notamment par des emplois publics. Les statistiques de l'agriculture et de l'emploi sont alors complètement transformées par la méthode des enquêtes par sondages aléatoires. Des chômeurs sont même recrutés pour effectuer sur tout le territoire ces nouvelles enquêtes, qui seront développées en Europe après la guerre.

Dans ce contexte de profond changement de l'action publique, des enquêtes statistiques qui semblent porter, au fil du temps, sur des sujets apparemment identiques, changent en fait de contenu et de signification. Ainsi les enquêtes antérieures sur les budgets ouvriers, qui ne concernaient que des familles de milieux populaires, deviennent, à partir des années 1950, les « enquêtes de consommation des ménages ». Elles portent désormais sur toutes les classes de la société, et visent notamment à quantifier la variable « consommation » de l'équation keynésienne. Elles servent aussi à déterminer les coefficients de pondération des biens de consommation entrant dans le calcul de l'indice des prix, qui, lui aussi concerne dorénavant les dépenses de toute la population et non plus seulement celles des seuls ouvriers.

Par ailleurs, l'État providence, tout juste esquissé à la suite de la crise de la fin du 19^{ème} siècle, se développe largement, et prend un nouveau sens, dans le contexte keynésien. En effet, les protections apportées par les assurances chômage, les allocations familiales, les retraites et même l'assurance maladie, contribuent à amortir les baisses de revenus et de consommation entraînées mécaniquement par les crises économiques. Ainsi les crises de 1975, 1993 et 2001 ont eu des effets beaucoup moins dramatiques que celle de 1929. Il en a été de même en 2008-2009.

La période des années 1950 à 1980 a vu le développement de vastes systèmes d'enquêtes sociales et économiques, orientées en partie, mais non uniquement, par les besoins de la comptabilité nationale, créée en France par Claude Gruson (Fourquet 1980). Un autre grand thème de cette période est la lutte contre les inégalités sociales, non seulement de consommation, mais aussi d'accès à l'école, à la santé, à la culture. Ces inégalités sont pensées en termes de groupes sociaux, à travers la grille des « catégories socioprofessionnelles », alors largement utilisée par la statistique publique, par la recherche universitaire et par les instituts de sondages commerciaux. Du côté des méthodologies, la macroéconométrie, introduite en France par Edmond Malinvaud, est mise en œuvre dans des modèles d'inspiration plus ou moins keynésienne, jusqu'aux années 1980, avant que n'intervienne la « théorie des anticipations rationnelles ». Celle-ci discréditera pour un temps les politiques keynésiennes, en invoquant l'idée que les acteurs, anticipant les effets des politiques publiques macroéconomiques, se comportent implicitement d'une manière qui annule les effets attendus de ces politiques.

1975-2010 : Nouveau management public, crise écologique, crise financière

La longue période de crise ouverte en 1975 par la brusque hausse du prix du pétrole a été vécue comme une complète remise en cause des modèles d'explication et d'action

issus de la crise précédente : discrédit des politiques keynésiennes et de la modélisation macroéconométrique, critique du rôle de l'État, dérégulation, idéalisation des mécanismes marchands supposés efficaces et autorégulés, financiarisation de l'économie, court-termisme des décisions au détriment des idées de prévision et de planification à long terme. Par ailleurs, la mise en place de l'Union économique et monétaire européenne et la création de l'euro confèrent une grande importance aux institutions de l'Union, et notamment à la Banque centrale européenne (BCE).

Ces évolutions marquent, d'une part, les productions des instituts de statistique publique, mais aussi, plus généralement, les usages des indicateurs quantitatifs, issus ou non de ces instituts. Ces usages sont inspirés des méthodes du « Nouveau management public » (New Public Management), diffusées en Grande-Bretagne dans les années 1980 et 1990 (Hood and Peters 2004 ; Lascoumes et Le Galès 2005). Ceci est le cas notamment en France avec l'application, à partir de 2006, de la « Loi organique relative aux lois de finances » (LOLF), qui s'appuie sur un grand nombre d'indicateurs de performances des administrations. Par ailleurs, la diffusion des techniques dites de « benchmarking » est caractéristique de la conception néolibérale de l'économie et du rôle de l'État, déjà bien anticipée par Michel Foucault dans ses cours de 1979 au Collège de France. La « Méthode ouverte de coordination » (MOC) utilisée par l'Union européenne, pour orienter les politiques sociales, est un bon exemple de cette technique. Elle repose sur des palmarès des performances des États selon divers indicateurs quantitatifs.

Les indicateurs conjoncturels mensuels et trimestriels (production, prix, emploi, commerce extérieur) sont réclamés dans des délais de plus en plus courts par la BCE, pour orienter une politique des taux directeurs hantée avant tout par la crainte de l'inflation. Du coup, la publication de ces indicateurs devient un événement médiatique, attirant commentaires et controverses, sur l'efficacité des politiques, et même sur d'éventuelles manipulations des chiffres et de leurs interprétations, notamment dans le cas du chômage. Cette polarisation sur les indicateurs conjoncturels va rendre d'autant plus surprenant et dramatique le retournement brutal de l'automne 2008, qui n'avait pas été mieux prévu que celui de 1929.

Une explication avancée (après coup) de cet aveuglement est l'absence de prise en compte des transformations des outils financiers (produits dérivés, titrisation), dans les analyses antérieures, centrées sur les variables économiques. Du point de vue des indicateurs quantitatifs, une conséquence, peu perçue mais grave, de la financiarisation a été notamment la modification des normes comptables européennes. Celle-ci vise désormais à valoriser les actifs du bilan à leur « valeur de marché » (c'est-à-dire de revente éventuelle), ou fair value, et non plus à leur coût d'origine. Cette façon de faire intéresse les investisseurs, les actionnaires et les spéculateurs, mais elle tend à rendre volatils les bilans des entreprises, et par là amplifie les variations des statistiques financières, ce qui aggrave la crise.

Les cours boursiers reflètent des phénomènes moutonniers instantanés. Ils sont, au moins à court terme, relativement déconnectés des évolutions économiques réelles. Ils fascinent les investisseurs financiers, mais ne font pas partie des modèles purement économiques. Mieux, l'indicateur le plus à même de refléter et même d'anticiper la gravité des crises financières, le « taux des prêts interbancaires » (le Libor), qui a atteint des sommets dès la fin de 2007, est peu connu et commenté par les médias, à la différence du CAC 40 ou du Dow Jones, affichés en continu par les chaînes d'information télévisées. Ce taux Libor augmente quand les banques ne se font plus confiance entre elles, et refusent de se prêter de l'argent. La brutale irruption des

phénomènes financiers est dans doute un des faits les plus marquants de la crise économique actuelle, mais ce n'est pas le seul. Sa survenue vient s'ajouter à celle, plus ancienne mais de plus en plus inquiétante, la crise écologique, et à l'angoisse du réchauffement climatique. Cette menace a relancé les critiques, déjà anciennes, des indicateurs économiques issus de la comptabilité nationale.

Les modèles économiques et, plus généralement, l'évaluation du niveau de vie et de la croissance d'un pays, font un large usage de l'agrégat central que constitue le Produit intérieur brut (PIB). Conçu à l'origine pour instrumenter les politiques keynésiennes, il est perçu aujourd'hui, à tort ou à raison, comme un indicateur (monétaire) de bien-être, sinon de bonheur. Ceci lui vaut maintes critiques : il ne reflète ni les inégalités sociales, ni les activités non monétaires (travail des femmes, travail bénévole), ni surtout les dégradations de la nature entraînées par les activités humaines, symbolisées aujourd'hui par les émissions de dioxyde de carbone (CO₂). Ces critiques, dont certaines remontent au célèbre « Rapport du Club de Rome » de 1971, sont à l'origine de nombreuses propositions de « nouveaux indicateurs de richesse ». Le plus célèbre d'entre eux est l'Indicateur de développement humain (IDH), popularisé par l'économiste indien [Amartya Sen](#). Sa formule, très élémentaire, est une moyenne entre la longévité humaine, le niveau d'éducation et le niveau de vie. Malgré son caractère fruste, cet indicateur a connu un grand succès. Une Commission présidée par Amartya Sen et Joseph Stiglitz a été chargée en 2008 par le Gouvernement français de faire des propositions visant à compléter les comptes nationaux par des évaluations des éléments sociaux et écologiques qui apparaissent désormais cruciaux. Elle a rendu son rapport en septembre 2009. Celui-ci propose le calcul d'un certain nombre de nouveaux indicateurs de bien-être. Par ailleurs, des chercheurs et des militants, regroupés en France en un « Forum pour d'autres indicateurs de richesse » (FAIR), tentent de susciter un large débat à ce sujet dans la société. Il est cependant encore difficile de prévoir complètement ce que seront les effets de la crise financière qui a explosé en 2008, en termes d'indicateurs statistiques. On peut supposer par exemple que le marché du carbone, ainsi que les effets possibles d'une éventuelle taxe carbone, pourraient constituer des indicateurs combinant les dimensions des deux crises.

Ainsi, la conjonction de ces deux crises, écologique et financière, pourrait être à l'origine d'une toute nouvelle configuration de la production et des usages des indicateurs statistiques. Des premiers exemples en sont fournis par l'importance prise par les travaux du Groupe international d'évaluation du climat (GIEC, en anglais : IPCC), et par les indicateurs d'émission de CO₂, de hausse des températures moyennes, de montée des océans, ou encore de l'empreinte écologique. Ainsi les crises sont, tout à la fois, représentées par des indicateurs statistiques, mais aussi à l'origine de vastes recompositions du paysage de ces indicateurs, comme l'ont montré les épisodes des années 1880, 1930, 1970 et 2000. Il est bien sûr difficile, dans le dernier cas, de prévoir ce que sera le paysage des années à venir. Il sera dessiné par ce que les citoyens du monde et leurs gouvernements décideront en dernier ressort de privilégier, parmi les aspects les plus graves de ces crises et parmi les moyens d'agir sur elles.



You are free to share, copy, distribute and transmit this content



12 rue d'Athènes 75009 Paris, France - Email : contact@paristechreview.com / Landline : +33 1 79 85 81 19