

QUALITÉ DES SOURCES

Le système statistique au cœur de la crise

TABLE RONDE ANIMÉE PAR SANDRA MOATTI, IDIES



La crise place le système statistique sous tension. Les décisions et anticipations des différents agents économiques (entreprises, décideurs publics, ménages) sont en effet directement influencées par les informations disponibles, notamment à travers les médias. La qualité de ces informations, la rapidité avec laquelle elles sont accessibles représentent donc deux enjeux essentiels.



Jean-Philippe Cotis,
DIRECTEUR GÉNÉRAL DE L'INSEE

Les informations pertinentes sur la sphère financière manquent

Quel est le lien entre l'information économique et statistique et la crise que nous connaissons ? Cette crise a-t-elle été aggravée par des défaillances de l'appareil statistique public ? Et si oui, quels remèdes apporter ? La réponse que je donnerai est la suivante : la crise que nous traversons aujourd'hui résulte à la fois d'une défaillance de jugement économique et d'un manque d'informations pertinentes sur la sphère financière.

A l'origine de cette crise, il y a, certes, un manque d'informations. Mais pas un manque relevant de la statis-

tique publique, au sens de l'Insee. Ce qui a manqué, c'est une information de gestion pertinente. Celle dont les régulateurs financiers ont besoin pour évaluer correctement les risques pris par les banques et les opérateurs financiers. Ce qui a cruellement manqué, en particulier, ce sont les informations portant sur les opérations financières hors-bilan. Les opérations qui ont permis à certains organismes financiers de contourner la réglementation et les ratios prudentiels. En particulier, dans le monde anglo-saxon. Il y a, à l'évidence, un gros travail à faire pour remettre à niveau

la régulation financière et le système d'information sur lequel elle peut s'appuyer.

J'ai évoqué le mot de crise du jugement économique pour mettre en évidence le fait que, dans sa très grande majorité, la profession des économistes n'a pas fait une bonne utilisation des indicateurs existants. Il y avait, rétrospectivement, des signaux d'alerte qui ont été négligés. Et qui suggéraient pourtant des risques de crise. Pour diagnostiquer la situation du secteur financier, on s'est trop contentés d'indicateurs internes à la sphère financière. Au détriment d'indicateurs reliant la sphère financière à la sphère réelle. Indicateurs qui, pris au sérieux, révélaient un risque de déconnexion entre ces deux sphères.

Il me semble, par ailleurs, que la statistique publique a beaucoup investi au cours des années récentes pour mieux appréhender les risques de retournement conjoncturel et que l'information statistique produite constitue un bon compromis entre célérité dans la publication et robustesse de l'information produite.

UNE STATISTIQUE PUBLIQUE EN PROGRÈS

La statistique publique a fait des progrès dans l'élaboration d'informations permettant de mieux prévoir les risques de retournement conjoncturel. Un retournement économique est un phénomène non linéaire. On passe rapidement d'un extrême à l'autre : du pic du cycle au creux de la récession.

Les conjoncturistes, en particulier ceux de l'Insee, ont développé au cours des années récentes des indicateurs très pointus pour déceler ces retournements de conjoncture. Ce qui améliore nos capacités de ●●●

**"LES ÉPISODES
OÙ LA SPHÈRE
FINANCIÈRE EST
DÉCONNECTÉE DE
LA SPHÈRE RÉELLE
SONT TRÈS
DANGEREUX"**

●●● prévision. Mais ces indicateurs nous renseignent sur la probabilité de retournement économique. Pas sur l'ampleur de la récession.

Nous disposons, par ailleurs, de bonnes enquêtes sur les anticipations des industriels. Chacun dit s'il est optimiste, pessimiste, ou neutre, sur l'état de ses débouchés. Une fois combinées, ces réponses individuelles permettent de faire des prévisions de croissance à court terme, raisonnablement précises. Mais la nature de la question posée – « êtes-vous pessimiste ou optimiste ? » – ne permet pas complètement d'appréhender les fluctuations économiques exceptionnelles.

Si tout le monde est pessimiste, on sait dire que les choses vont très mal, mais pas nécessairement qu'une crise majeure à l'échelle du siècle est en route. Nos enquêtes sont construites pour appréhender le plus finement possible les fluctuations conjoncturelles normales. Pas pour appréhender dans toute leur ampleur les crises historiques.

Nous n'avons pas suffisamment d'observations pour cela.

Je vous ai parlé jusqu'ici de notre appareil d'enquêtes conjoncturelles qui sont des instruments de prévision à court terme. Les statistiques, elles, cherchent à capturer le passé récent. Elles sont par nature rétrospectives. Elles peuvent aider à mieux comprendre ce qui vient de survenir. Ce qui est important pour l'avenir. Ayant bien quantifié les évolutions récentes, on peut plus facilement se prononcer sur la trajectoire future de l'économie. Si l'économie se trouve, par exemple, dans une situation où la demande globale de biens et services est très inférieure à l'offre productive, on peut conclure, le plus souvent, que la reprise sera forte.

Un appareil statistique de qualité est également nécessaire pour appré-

hender les coûts sociaux de la crise : l'ampleur du chômage, du sous-emploi dans ses diverses formes, les retombées diverses en termes de pertes de bien-être et de risque d'exclusion sociale.

Dans ce domaine de la statistique sociale, l'Insee et le service statistique public dans son ensemble ont accompli des efforts considérables au cours des années récentes. Nous sommes donc mieux armés pour piloter les politiques sociales, dans le long terme, tout autant qu'en période de crise.

**UNE LECTURE
PEU ATTENTIVE
DES SIGNAUX DE CRISE**

L'analyse que je vais développer relève de la macroéconomie financière, l'interface entre la macroéconomie et la finance. L'histoire économique nous enseigne que les épisodes où la sphère financière est déconnectée de la sphère réelle sont très dangereux. En particulier lorsque cette période de lévitation se prolonge. Dans ces périodes, le coût du capital est perçu comme très faible par les agents économiques et financiers. Et la prise de risques est extrême. Des secteurs comme l'immobilier et la Bourse acquièrent une dynamique autonome, déconnectée des fondamentaux, dissociée de la sphère réelle (c'est-à-dire de la production).

Il est donc impératif de disposer d'indicateurs permettant de jauger la surextension des marchés financiers. Il y a des cas où l'on peut « facilement » diagnostiquer le risque d'une crise financière. En particulier lorsque par ailleurs la sphère réelle, le marché des biens et services, est elle-même en surchauffe.

En 2006-2007, ce n'était pas le cas, la sphère réelle était particulièrement stable : pas d'inflation et une croissance économique régulière. Et cela, en gros, depuis vingt ans. Cette période était même appelée par les économistes : la « grande modération » ! Puisqu'on ne décelait aucun risque de crise du côté de la sphère réelle, il fallait donc investi-

guer la sphère financière : ce que les économistes ont fait au cours des années 2006-2007. Sans véritablement conclure.

Ils ont vérifié notamment la solvabilité des acteurs économiques, c'est-à-dire le risque de surendettement. De cet examen, ils ont conclu que les acteurs économiques étaient solvables. Les ménages étaient certes endettés, mais ils avaient en contrepartie un patrimoine immobilier de grande valeur. Les entreprises avaient souvent une forte dette, mais leurs fonds propres, tels que mesurés par leur capitalisation boursière, étaient élevés ! Tout au moins, en apparence...

Il y avait bien sûr une inquiétude sur les marchés immobiliers *subprime*. Mais c'était un segment de petite taille. A lui seul, il ne constituait pas une source d'inquiétude systémique. De manière générale, le problème, c'est que l'on comparait entre elles des valorisations financières qui étaient toutes inflatées.

Ceux qui étaient les plus circonspects ont pour leur part exploré également des indicateurs mixtes : sphère réelle/sphère financière. Ils avaient bien en tête que le problème posé par les indicateurs strictement financiers, c'est qu'en période d'« exubérance irrationnelle », les dettes et les actifs augmentent de conserve. Ils gardent peut-être entre eux un rapport stable, mais au risque d'une déconnexion avec la sphère réelle. La sphère de la production. Dans un tel contexte, il faut donc privilégier des indicateurs mixtes : sphère financière/sphère réelle.

Je voudrais vous donner deux exemples d'indicateurs mixtes concernant l'immobilier, d'une part, et la Bourse, d'autre part. Le meilleur indicateur de « surextension immobilière » est, de mon point de vue, le ratio : prix du logement/loyer. Si le prix des maisons augmente pour des raisons physiques, par exemple la rareté des terrains à bâtir, alors les loyers et les prix de l'immobilier augmenteront de concert. Le ratio ne changera pas. Il n'y a pas de complication financière en ●●●

●●● vue. Si, en revanche, le prix du logement augmente beaucoup plus vite que les loyers, alors il y a risque de déséquilibre financier. Et, ce ratio prix du logement sur loyer avait beaucoup augmenté dans les années précédant la crise. Ce type d'indicateurs a été publié à intervalles réguliers par certaines institutions publiques. Mais il n'a pas vraiment capté l'attention des décideurs privés, qui ont souvent fonctionné à partir d'une logique purement financière.

Un autre exemple d'indicateur mixte sphère financière/sphère réelle, c'est le Q de Tobin : le ratio entre la valeur boursière des entreprises et la valeur de leur capital physique au coût de remplacement. En gros, plus la valeur boursière de l'entreprise s'élève au-dessus de sa valeur physique, plus les marchés anticipent une forte croissance des bénéfices. Une croissance éventuellement irréaliste. Ce type de ratios peut aider à appréhender d'éventuelles complications financières.

Autre exemple de ratio qui est fréquemment regardé par les marchés, le ratio cours de Bourse/profit. Ici, on observe bien un indicateur mixte. Le problème vient de ce que les profits sont très cycliques. Il faut donc expurger les profits, au numérateur de leur composante cyclique, ce qui n'est pas toujours facile.

Pour résumer mon propos, il me semble que la description statistique de la sphère réelle est de bonne qualité en France, comme d'ailleurs dans de nombreux pays. Des progrès continuent à être accomplis, ce dont on peut se féliciter. Là où il va falloir beaucoup travailler, c'est sur la statistique financière. Il faudra aussi mieux utiliser et mieux valoriser ces indicateurs à la charnière des sphères réelles et financières, que j'ai longuement évoquées. Je ne prétends pas, bien sûr, qu'avec un usage raisonné des meilleurs indicateurs, on aurait évité la crise financière. Mais ils auraient pu contribuer à améliorer le diagnostic. ♦



Xavier Timbeau,
 DIRECTEUR DU DÉPARTEMENT ANALYSE ET PRÉVISION À L'OFCE

Le système statistique a un train de retard qui paralyse la décision

Dans la crise que nous venons de vivre, l'appareil statistique français et l'utilisation que font les économistes des données qui en sont issues n'ont pas rempli leur office. Les statistiques n'ont pas permis de donner suffisamment tôt les éléments et les arguments pour pouvoir comprendre ce qui se passait et enclencher les réponses de politique économique qui pouvaient être nécessaires. On sait aujourd'hui que la France est entrée en récession à partir du deuxième trimestre 2008 de façon assez significative et qu'il y a eu une accélération très brutale de cette récession à partir du quatrième trimestre de cette même année 2008, avec ensuite un premier trimestre 2009 très mauvais. Une situation inédite en termes de conjoncture.

Mais l'Insee, à travers sa note de conjoncture, n'a commencé à nous renseigner sur cette situation qu'à partir du mois de décembre 2008, alors que ce processus était déjà largement enclenché. La banque Lehman Brothers avait en effet déjà fait faillite, des centaines de milliards de dollars avaient déjà été dégagés pour sauver le système bancaire.

DÉCOUPLAGE ?

Trois mois plus tôt, en octobre 2008, date à laquelle est discuté le budget en France, la vision que l'on avait de la conjoncture reposait encore sur la théorie du découplage : on pensait que les Etats-Unis étaient en train de subir une correction liée à toutes les folies qu'ils avaient faites, mais que le reste du monde allait échapper à ces turbulences. Il n'y avait donc, selon cette analyse, pas grand-chose à faire

en matière de politique économique. En juin 2008, enfin, on pensait que l'élément négatif qui jouerait sur la conjoncture européenne était la hausse du pétrole, dans la mesure où elle aurait potentiellement des conséquences inflationnistes. A ce moment-là, quelques mois avant que la crise n'explode, la Banque centrale européenne a relevé ses taux d'intérêt. Selon son analyse, il y avait de la croissance, les ménages continuaient à consommer, et donc le vrai risque que courait l'économie européenne était lié à l'inflation. Il convenait donc d'y réagir par une hausse des taux d'intérêt.

Mais à cette époque, les Etats-Unis les avaient déjà réduits depuis au moins trois mois. Le découplage n'était donc pas seulement une théorie ; il se traduisait en termes de politiques économiques. Résultat : les décisions de politique monétaire de l'été 2008 comme les décisions de politique budgétaire initiale prises en septembre-octobre 2008 reposaient sur l'analyse : « il n'y a pas grand-chose à craindre pour l'Europe. »

En décembre 2008, donc, quand pour la première fois l'appareil statistique commence à prendre la mesure de la crise qui est en train de se dérouler, avec six mois de retard sur son déclenchement, son ampleur est largement sous-estimée. A ce moment-là, l'Insee anticipait une ●●●

"L'APPAREIL STATISTIQUE A PRIS LA MESURE DE LA CRISE AVEC SIX MOIS DE RETARD"

●●● réduction d'activité d'un point au cours du quatrième trimestre 2008. En fait, ce point de réduction d'activité était déjà acquis dès le troisième trimestre 2008. Aujourd'hui, deux points et demi supplémentaires de réduction d'activité ont été rajoutés. L'ampleur de la crise en décembre 2008 a donc été sous-estimée d'un tiers par rapport aux données dont on dispose aujourd'hui.

INFORMATIONS DÉPASSÉES

Cela n'est pas sans conséquences : lors de la discussion du budget, rien n'est fait, car on considère qu'il n'y a pas beaucoup de choses à faire. On juge alors qu'il faut faire attention au déficit, ce qui veut dire ne pas faire de

politique budgétaire. Cette stratégie va être révisée au cours de l'automne et de l'hiver 2008 avec une série de collectifs budgétaires.

Mais ces collectifs sont adoptés sur la base d'une information qui sous-estime d'un facteur trois l'ampleur de ce qui est en train de se passer en France. Même les décisions qui sont prises tardivement le sont avec des informations dépassées.

Nous sommes incapables de donner des informations en temps réel sur ce qui se passe.

L'exemple anglais est révélateur : les données conjoncturelles pour le troisième trimestre 2009 qui ont été publiées très tôt par les Britanniques indiquent un retrait de l'activité à -0,4, alors que toutes les anticipations – qui sont basées sur des informations telles que la production industrielle, les enquêtes réalisées auprès des entreprises et des consommateurs, etc. – indiquent une reprise de l'ordre de 0,2.

Entre les deux, il y a 0,6 de différence. 0,6 c'est considérable comme différence : dans un cas, on est dans une amélioration de la conjoncture,

dans l'autre, dans une continuation de la dégradation. Les conclusions que l'on peut en tirer en matière de politique économique sont radicalement opposées. Soit on fait attention au budget, soit on continue à faire de la relance.

Pour résumer, la statistique est tiraillée entre deux exigences. D'un côté, nous cherchons à avoir une vision la plus juste, la plus précise et la plus exhaustive possible de l'activité économique qui est faite dans notre pays. De l'autre, il est nécessaire d'accéder à l'information en temps réel. C'est-à-dire d'avoir un chiffre qui correspond le plus possible à l'état de l'économie au moment où il est produit. Ce chiffre est important, car il va conditionner les décisions de politique économique qui sont prises. Dans un cas, l'accent

est mis sur les politiques structurelles, l'enjeu est de savoir combien on produit de richesses, comment elles sont produites. Dans l'autre, nous avons besoin d'un outil conjoncturel qui nous dise si l'économie est en train de se contracter ou non, s'il faut augmenter les taux d'intérêt ou pas, s'il faut engager une politique de relance.

La tension qui existe entre ces deux pôles d'exigences est aujourd'hui mal gérée par l'appareil statistique. Le système des comptes nationaux trimestriels vise à remplir en même temps ces deux contraintes. Mais c'est une illusion de croire que l'on peut produire une information qui combine en même temps ces deux exigences. La crise vient de nous le prouver : nous avons un train de retard qui paralyse la décision. ♦

"NOUS SOMMES INCAPABLES DE DONNER DES INFORMATIONS EN TEMPS RÉEL SUR CE QUI SE PASSE"



Jacques Anas,
DIRECTEUR DES INDICATEURS ÉCONOMIQUES
ET DES MODÈLES STATISTIQUES À COE-REXECODE

Des informations financières aux mains du privé

Tout d'abord, je voudrais rappeler que le mot statistique vient du mot Etat. Les statistiques ont eu pour premier usage d'aider les gouvernements, et les instituts étaient d'ailleurs souvent assez proches du pouvoir. Mais aujourd'hui, les statistiques concernent tout le monde : les gouvernants pour la bonne conduite des politiques économiques, mais aussi les citoyens qui ont leur mot à dire. N'oublions pas également les entreprises, qui ont besoin d'informations pour leur gestion courante, pour leurs investissements. On l'a vu, par exemple, avec l'automobile l'année dernière, où des sous-traitants se sont plaints d'avoir pris conscience trop tard de ce qui se passait et d'avoir été confrontés à de gros problèmes, les grandes entreprises automobile ne

leur ayant peut-être pas passé le message assez rapidement.

La crise, on le sait, a été essentiellement financière. Or, on a du mal aujourd'hui à bien mesurer les développements financiers. Mais un train peut en cacher un autre : derrière cette crise financière se cache une autre crise liée à l'entrée des géants que sont la Chine et l'Inde sur la scène internationale depuis moins de dix ans. Je pense que les économistes n'ont pas pris tout de suite la mesure de ce phénomène.

RIEN À SIGNALER

La crise que l'on traverse trouve ses origines également ici : il y a une forte pression sur la demande d'énergie, sur l'environnement. Et cette pression pose des questions ●●●



●●● nouvelles. L'année dernière, la forte augmentation du prix des matières premières était symptomatique du fort déséquilibre entre l'offre et la demande au niveau mondial.

Quel a été le degré de fiabilité du système statistique face à la crise ? Pour répondre à cette question, il faut distinguer les aspects conjoncturels et structurels. Du point de vue conjoncturel, rien à signaler. Le système statistique qui nous informe sur l'économie réelle fonctionne bien dans son ensemble, il y a eu des progrès importants.

Certes, les données sont révisées, mais ce n'est pas nouveau. Elles l'ont toujours été. On n'échappera pas à ce problème de révision, surtout si l'on veut des statistiques plus rapidement. Aux Etats-Unis, par exemple, ils ont opéré d'importantes révisions des comptes nationaux qui nous donnent une autre lecture de 2007-2008.

Deuxième aspect : la volatilité des chiffres. Ce n'est pas nouveau non plus. A chaque fois que l'on se trouve face à une crise, ces questions prennent un peu plus d'acuité.

Au-delà de l'information statistique proprement dite, se situe le décryptage de la réalité. C'est un stade plus élaboré, où la concurrence est stimulante. Si au niveau de la production statistique, un monopole public peut se justifier, en ce qui concerne son analyse et son décryptage, il peut y avoir une place pour la concurrence. L'Insee a fait beaucoup d'effort pour mettre en palce des indicateurs de retournement.

Sur le marché, il y en a d'autres, COE-Rexecode en produit par exemple. Il ne faut donc pas confondre système de production statistique et indicateurs qui décryptent la réalité.

Une autre source de confusion peut exister entre système d'information et prévision. Evidemment, dans le système d'information, il y a les prévisions de ceux qu'on interroge, leur opinion. Mais la prévision, elle, est faite à partir de modèles. La question qui est posée aujourd'hui est de savoir si on a eu les

bons modèles, si on a réussi à faire les bonnes analyses. Or, un bon modèle repose sur des informations fiables permettant d'avoir une vision pertinente du présent.

MAUVAISE CONNAISSANCE

Le gros du problème concerne l'information financière. Elle a des failles. On a eu une mauvaise connaissance de ce qui s'est passé. Les informations sont aux mains du privé, il est difficile d'aller les chercher. Il y a beaucoup d'indicateurs partiels concernant les CDS, les CDO, les ABS, il a fallu collecter tout ça, mettre en forme ces données et les comprendre petit à petit. Du point de vue des enquêtes, il y a eu un double malaise. Le premier concerne l'écart sociologique entre la

mesure de la réalité et le ressenti des acteurs économiques. Par exemple sur l'inflation. Le second problème est que les enquêtes ne nous ont pas bien aidés à comprendre comment se développait la crise et, surtout, à quelle amplitude. Pour des raisons de non-linéarité, elles ne nous ont pas été utiles.

Sur les questions structurelles, enfin, il y a des choses à faire. Cela renvoi aux failles des relations entre finance et économie. Est-ce qu'on ne pourrait pas avoir, par exemple, un indicateur global des prix, c'est-à-dire ne pas avoir, d'un côté, un indice d'inflation des biens et services et, de l'autre, des indices d'inflation des actifs. Cela permettrait d'avoir une vision un peu plus globale de la problématique. ♦



Jacques Freyssinet,
PROFESSEUR ÉMÉRITE DES UNIVERSITÉS, ANCIEN PRÉSIDENT
DE LA COMMISSION EMPLOI-REVENUS DU CNIS

La crise renforce les exigences vis-à-vis du système statistique

La crise économique actuelle ne modifie pas la nature de la demande sociale d'information statistique, mais elle accentue le poids de certaines exigences à l'égard du système statistique, en particulier de la statistique publique. En termes de pertinence de l'information, telle qu'elle permette de mettre en évidence la spécificité des impacts économiques et sociaux de la crise. En termes d'accessibilité, non seulement du point de vue de la commodité d'usage des sites, mais surtout des possibilités d'appropriation des notions par les utilisateurs non experts. En termes de rapidité, pour rendre compte d'évolutions souvent brutales et imprévisibles en temps de crise. Et enfin, en termes de fiabilité, non seulement du point de vue de la déontologie des statisticiens,

mais surtout de la confiance qu'accordent les utilisateurs à l'information statistique de telle sorte qu'ils l'acceptent comme une référence commune pour le débat social. Bien entendu, la poursuite conjointe de ces objectifs est génératrice de tensions, voire de contradictions. Nous l'illustrerons sur trois exemples.

PRIX, POUVOIR D'ACHAT, NIVEAUX DE VIE

Le passage à l'euro a coïncidé dans les pays concernés avec un sentiment de déconnexion entre la perception subjective de l'évolution des prix et sa mesure statistique. Il en a résulté un sentiment de méfiance dans l'opinion publique à l'égard de l'indice des prix à la consommation, sentiment récemment amplifié par l'annonce d'une baisse de cet indice. ●●●

ACTES (1/2)

● Cette septième note de travail de l'Idies est le compte rendu de la première table ronde des Deuxièmes rencontres annuelles de l'Idies, qui ont eu lieu le 12 novembre 2009, à Lyon, dans le cadre des Journées de l'économie et avec le soutien du Grand Lyon. L'intégralité des débats est disponible sous format vidéo sur le site www.idies.org

● La deuxième table ronde (sur l'information économique en entreprise en période de crise), a fait l'objet d'un compte rendu spécifique qui a également été publié sous la forme d'une note de travail. A télécharger sur le site www.idies.org, rubrique « Publications ».

"LA CRISE CRÉE UN BESOIN URGENT DE MISE EN PLACE D'UN DISPOSITIF INTÉGRÉ DE SUIVI DES TRANSFORMATIONS DE L'EMPLOI"

●●● Dans ce contexte, la priorité pour l'appareil statistique est de combiner un travail de clarification pédagogique avec un effort de diversification de l'information, ce qui n'est pas forcément compatible. Le travail

pédagogique porte sur l'explicitation des différences entre indices de prix, de coût de la vie, de niveau de vie... La diversification consiste, par exemple, à calculer des indices par catégorie socioprofessionnelle ou par décile de revenu, ou encore à distinguer les variations de prix qui portent sur les dépenses contraintes de celles qui concernent les dépenses discrétionnaires. La difficulté est que l'on

passse de la magie du chiffre unique à l'effet souvent démoralisant et démobilisateur de la prolifération de l'information.

Un des débats majeurs engendré par la crise est celui de l'évolution du pouvoir d'achat des salariés ou, plus exactement, des différentes catégories de salariés et de chômeurs, partiels ou complets. Il s'agit à la fois d'une question de justice sociale (comment se répartit le coût de la crise ?) et d'un enjeu de politique économique (quel mode d'action sur la demande solvable dans une stratégie de sortie de crise ?).

EMPLOI ET CHÔMAGE

La controverse engendrée par le refus de publication, au début de 2007, des résultats de l'enquête Emploi de 2006 a porté un rude coup à la réputation d'indépendance et de transparence de l'Insee. L'ampleur des réactions des acteurs sociaux a eu des effets positifs. A la suite du rapport conjoint de l'Inspection générale des Finances et de l'Inspection générale des affaires sociales et, surtout, du rapport du groupe de travail du Conseil national de l'information statistique (Cnis),

présidé par Jean-Baptiste de Foucauld, des progrès notables ont été réalisés : dissociation entre les statistiques des demandeurs d'emploi et celles du chômage ; publication trimestrielle par l'Insee d'informations enrichies sur l'emploi, le chômage, le sous-emploi, le halo autour du chômage... ; clarification des catégories de demandeurs d'emploi et diffusion d'informations plus détaillées les concernant.

Il est heureux que ces avancées aient été réalisées pour l'essentiel dès le début de 2008, de telle sorte que nous avons disposé d'une information améliorée et homogène pour suivre l'impact de la crise. Mais celle-ci a aussi mis en évidence des lacunes qui, jusqu'alors, pouvaient paraître secondaires et qui sont désormais un grave obstacle à l'analyse des évolutions du marché du travail. Par exemple, la connaissance du nombre des licenciements économiques est très mauvaise et l'on ne peut identifier ceux qui résultent de restructurations industrielles ou seulement de fluctuations conjoncturelles. Il faut juxtaposer des informations hétérogènes fournies par des sources différentes selon des calendriers différents et qui concernent les causes d'inscription à Pôle emploi, les autorisations de recours au chômage partiel, les entrées et les stocks en convention de reclassement personnalisé (CRP) et contrat de transition professionnelle (CTP), le nombre de programmes de sauvegarde de l'emploi (PSE) notifiés par les entreprises à l'administration... La crise crée un besoin urgent de mise en place d'un dispositif intégré de suivi conjoncturel et structurel des transformations de l'emploi ainsi que du volume et de la nature des mobilités qui en résultent.

PAUVRETÉ ET INÉGALITÉS

Le rapport du Cnis portant sur ce thème a conduit le système statistique public, en particulier l'Insee, à réaliser un effort important pour améliorer et accélérer la production d'informations détaillées qui sont aujourd'hui réunies sur un site ac-

cessible à tous (www.insee.fr, dossier « Inégalités sociales »).

Dans ce domaine, la difficulté principale résulte du retard dans la production des données. Ce retard est difficilement réductible puisqu'un grand nombre des chiffres proviennent de sources fiscales pour les revenus ou d'enquêtes à réalisation espacée s'il s'agit des patrimoines.

Pour l'analyse des conséquences de la crise, une question importante est celle de la production d'indicateurs avancés, en particulier dans le domaine de la pauvreté et de l'exclusion. L'Observatoire national de la pauvreté et de l'exclusion sociale (Onpes) réalise un utile effort méthodologique dans ce domaine. L'une des difficultés naît de la production d'estimations provisoires ou de résultats de simulations ; ils risquent d'être fortement corrigés par la suite et créent ainsi un doute dans l'opinion publique sur la fiabilité des chiffres. Ici encore, un effort pédagogique d'explicitation des méthodes et de mesure des marges d'incertitude est indispensable. Il est clair que l'attente de chiffres indiscutables rendrait impossible la mesure en temps utile des coûts sociaux de la crise. Des arbitrages sont nécessaires à condition que leurs termes soient clairement expliqués et que les risques de manipulation soient combattus.

Les enjeux du débat social sur les conséquences économiques et sociales de la crise actuelle rendent crucial le renforcement des garanties qui doivent porter, d'une part, sur la qualité et l'indépendance du système statistique public, d'autre part, sur sa capacité de répondre aux transformations de la demande sociale qui lui est adressée. Dans le premier domaine, il faut attendre que l'Autorité de la statistique publique, récemment créée, fasse ses preuves. Dans le second domaine, il faut souligner le rôle essentiel joué par le Cnis comme lieu d'expression des besoins des acteurs sociaux et comme instance de débat critique sur les réponses qui leur sont fournies. ♦



Pascal Riché,
RÉDACTEUR EN CHEF DE « RUE89 »

Quand la statistique boit, la presse trinque

Dans le film E.T., le petit extraterrestre entre en symbiose avec l'enfant qui l'a recueilli. Et lorsqu'il se met à boire de la bière, c'est le jeune Elliot qui trinque : il devient ivre et accumule les bêtises. Il se passe à peu près la même chose entre la statistique et la presse. Quand la suspicion est jetée sur le travail des statisticiens, la presse en pâtit toujours. Ce fut le cas quand il y a eu un divorce entre la mesure de l'inflation par l'Insee et la perception qu'en avaient les Français : la suspicion est retombée sur les médias. Les gens ont l'impression qu'on leur ment. Ils le disent, et pas seulement dans les cafés. A la Sorbonne, quand Nicolas Sarkozy a présenté les travaux de la commission Stiglitz, il a déclaré : « *Les citoyens pensent qu'on leur ment, que les chiffres sont faux, qu'ils sont manipulés et ils ont quelques raisons d'être dans cet état d'esprit.* » Ce type de discours, quelque peu démagogique, va à l'encontre de la statistique, mais accroît aussi la suspicion vis-à-vis des médias. C'est pour cela que les problèmes de la statistique publique intéressent au premier chef les journalistes. D'autant qu'ils sont très voisins des nôtres.

INDÉPENDANCE

En effet, quels sont les problèmes auxquels nous sommes confrontés ? On considère souvent que la presse souffre d'un problème d'indépendance. Elle est par ailleurs accusée de vivre enfermée dans une bulle, dans un univers de connivences ; on lui reproche sa piètre qualité, en partie liée à la hiérarchisation des sujets ou à la lisibilité ; elle souffre, enfin, d'un problème de concentration.

Pour la statistique, c'est à peu près la même chose. Il est important d'avoir une statistique indépendante. C'est capital pour la fiabilité des résultats, mais aussi pour la finalité même du travail des statisticiens. Ils ne doivent pas uniquement travailler pour le pouvoir, mais pour l'ensemble de la société civile. Jusqu'à une date très récente, il n'y avait aucun texte de loi qui garantissait l'indépendance de l'Insee. La loi sur la modernisation économique le précise désormais, et instaure une autorité de la statistique. Mais l'indépendance de cette nouvelle instance est sujette à caution, car le conseil de cette autorité est nommé par le pouvoir politique.

L'indépendance est également remise en question lorsque l'on apprend que telle ou telle étude n'est pas publiée, car elle déplaît à tel ou tel cabinet. Ou lorsque la Dares prépare une note sur l'emploi et que le cabinet force le chercheur concerné à changer une phrase. Très souvent, on constate de petits problèmes d'indépendance de ce type qui ne renforcent évidemment pas la confiance que les citoyens peuvent avoir dans les statistiques et, par ricochet, dans les médias. Dans certains pays scandinaves, au contraire, toutes les statistiques sont publiées sans consultations des cabinets ministériels, c'est-à-dire que le citoyen est informé exactement au même moment que le pouvoir politique. Je pense qu'on pourrait s'inspirer d'un tel exemple.

Concernant la qualité, un dilemme se pose entre robustesse et célérité. C'est un problème que les journalistes connaissent bien ! Certaines statistiques sont tellement peu fraîches que l'on ne sait pas trop quoi en faire. C'est le

cas des données sur le patrimoine qui ont quatre ans, ou de celles sur le revenu qui ont trois ans. Un économiste m'a récemment dit qu'il travaillait sur des chiffres de 2001 pour les successions et les donations ! On se demande quel est l'intérêt pour le débat public. Aux Etats-Unis, le système statistique est beaucoup plus rapide sans que la qualité des données en souffre énormément.

Pour comprendre la crise, on aimerait disposer de statistiques plus rapidement. Une idée : pourquoi ne pas moduler le budget des administrations statistiques en fonction de la conjoncture ? En période de crise, on débloquerait des crédits supplémentaires pour la statistique. En période de calme, on réduirait ces budgets...

DICTATURE DE LA MOYENNE

En ce qui concerne les champs couverts par la statistique, de nombreux progrès ont été réalisés ces dernières années. Mais tout n'est pas réglé. C'est le cas par exemple de la « dictature de la moyenne » qui est toujours d'actualité. J'ai fait une recherche récemment pour savoir quelle était la progressivité de l'impôt sur les personnes : impossible d'obtenir ces données par déciles. Autres problèmes de qualité, ceux qui touchent à la présentation des résultats.

Enfin, les statisticiens sont perçus comme vivant dans des bulles, ne reconnaissant jamais leurs erreurs. Ce phénomène est accentué en France, où les statisticiens s'occupent à la fois de la collecte et de l'analyse des données. Ils ont donc une sorte de magistère sur l'interprétation des données, ce qui peut faire souffrir un certain nombre de chercheurs qui ont parfois du mal à obtenir les chiffres dont ils ont besoin. Je propose d'ouvrir ce monopole. Pas forcément sur la collecte, mais sur l'interprétation des données. Il faut mettre l'ensemble des données brutes à disposition d'une kyrielle d'organismes, d'entreprises, d'instituts, ou de journalistes capables de les lire. ♦



« Les Chantiers de l'Idies » est une publication éditée par l'Institut pour le développement de l'information économique et sociale (Idies), une association à but non lucratif (loi 1901), domiciliée au 28, rue du Sentier, 75002 Paris.

Pour nous contacter : contact@idies.org

Pour en savoir plus : www.idies.org

Directeur de la publication : Daniel Lenoir.

Rédaction : Laurent Jeanneau. Secrétariat de rédaction : Martine Dortée. Edité avec le soutien technique d'Alternatives Economiques.

Conception graphique : Christophe Durand (06 12 73 34 95).