

## Connaissances et diffusion des statistiques internationales

**Compte rendu du colloque qui s'est tenu à l'Université de Genève les 11 et 12 juin 2009, organisé par l'Observatoire de la finance et le Laboratoire d'économie appliquée de la Faculté de Sciences économiques et sociales, grâce au soutien du Réseau suisse pour les études internationales (RéSEI), anciennement RUIG.**

Un grand nombre de problématiques relatives à tous les maillons de la chaîne du producteur ou consommateur des informations chiffrées - la production, la diffusion et la communication, la compréhension et l'utilisation - ont été examinées et abordées par les experts réunis lors de ce colloque sur les statistiques internationales.

Les crises, qu'elles soient économiques, financières, sociales, démographiques, alimentaires, environnementales, voire humanitaires, posent à chaque fois la question de la pertinence de l'outil statistique et de l'adéquation des connaissances obtenues grâce au chiffrage des phénomènes observés. A trop se focaliser sur les chiffres disponibles, on risque de passer à côté de l'essentiel, c'est-à-dire des conditions précises de leur élaboration, dans le respect d'une éthique qui refuse de sacrifier la fiabilité, l'exactitude et la compréhension des données sur l'autel de la rapidité et de la publicité. Toujours plus de chiffres ne permettent pas de faire l'économie des concepts permettant de les décrypter.

En particulier en période de crise, la question du besoin d'éventuelles nouvelles statistiques et données se pose de façon plus aiguë. Les quelques chiffres manquants, imagine-t-on, auraient peut-être permis de prévenir ou du moins d'atténuer les turbulences. Tel n'est pas nécessairement le cas, mais la grave crise financière actuelle contribue à une prise de conscience des difficultés de toute entreprise de chiffrage et met en exergue les défis actuels et futurs posés aux systèmes et méthodes statistiques.

### De la production et de la diffusion des statistiques au service du public

Dans son exposé introductif et détaillé, **Heinrich Brünger**, ancien Directeur de la Division statistique de la Commission Economique des Nations Unies pour l'Europe, à Genève, a présenté avec humour et passions quelques-uns des défis relevés avec succès ces dernières années et ceux encore pendants des statistiques internationales.

Trois points importants doivent être gardés à l'esprit par l'utilisateur des statistiques (internationales) :

- faire de la statistique signifie dénombrer, ou compter pour connaître l'étendue du phénomène qu'on veut mesurer sur la base de concepts (théoriques). Certaines choses sont alors mesurables, avec plus ou moins de précisions, d'autres ne le sont pas, ou pas encore, ou avec une grande difficulté;
- le phénomène observé qu'on veut mesurer se modifie constamment, comme d'ailleurs les méthodes et les sources des statistiques, ce qui ne facilite pas la lecture et l'interprétation des données. Des ajustements de la statistique à l'évolution politique, sociale et économique sont donc nécessaires, à l'exemple de la statistique démographique: la libre circulation à l'intérieur de l'Union européenne (UE), sans obligation faite aux personnes sans activité lucrative de s'annoncer aux autorités de leur nouveau pays de résidence, peut fausser les chiffres des migrations et, partant, ceux des populations résidentes ; autre

exemple : le développement rapide des prestations de services (sur Internet), qui ne laissent pas de traces aux frontières complique l'élaboration des statistiques sur le commerce et les échanges.

- les organisations internationales ne sont pas elles-mêmes à la source des données, mais elles puisent dans les sources nationales à l'aide de procédures standard de transmission de données. Par contre les organisations internationales jouent un rôle capital dans la standardisation et l'adoption par les pays membres des standards en matière statistique.

L'UNECE a défini dès 1992 des principes fondamentaux de l'élaboration de statistiques officielles, dont notamment l'impartialité, la transparence des sources et des méthodes, la confidentialité des données qui doit interdire l'identification des personnes et des entreprises, l'économicité des relevés et l'assurance de qualité.

Par exemple, en matière d'indépendance, l'interférence politique lors des publications peut être réduite ou contrecarrée par l'établissement d'un calendrier de la diffusion des informations statistiques produites. Paradoxalement, l'indépendance par rapport au politique ou aux groupes de pression n'est à l'heure actuelle pas assurée dans les organisations internationales et dans beaucoup d'Etats membres (comme certains pays de transition ou émergents). Dans certains pays de tradition autoritaire, des pressions existent encore pour «arranger» les chiffres ou faire coïncider leur publication avec les impératifs du calendrier politique. L'amélioration de la gouvernance dans les statistiques internationales passe aussi par une aide aux services statistiques nationaux des pays émergents et moins développés. La qualité dans le temps de la production statistique peut être évaluée par exemple par un contrôle mutuel des organisations et procédures tel qu'il est pratiqué obligatoirement en UE dans le cadre des « peers reviews ».

Au-delà des questions liées la production pure des chiffres, les statisticiens commencent aussi à se soucier de la diffusion et de la compréhension de leur production, et ceci parfois en contradiction avec les responsables financiers des Organisations soucieux de contribuer au financement et à la couverture du coût des prestations.

L'Organisation de coopération et de développement économique (OCDE) a ainsi créé un outil interactif accessible en ligne pour faciliter la consultation de différentes banques de données (OECD Explorer). Présenté par **Trevor Fletcher**, Head of Statistical Information Management and Support Division, ce logiciel accessible par Internet permet à l'utilisateur de construire très facilement des « stories » à l'aide de cartes informatives, graphiques et autres diagrammes. Cet outil comporte toutefois un obstacle majeur à une large utilisation, celle de la compréhension – et de la sélection - même des chiffres trouvés et de leur éventuelle évolution. Pour l'heure, l'outil est surtout utilisé par des experts ou des utilisateurs plutôt bien informés

Le problème de la compréhension des statistiques ou/et de leurs concepts sous-jacents passe par l'enseignement et l'apprentissage. L'institut UNITAR (United Nations Institute for Training and Research) a mis sur pied un programme d'apprentissage à distance destiné notamment aux décideurs de pays en développement, africains en particulier. Le e-learning permet non seulement de proposer «une formation sans frontières» de haut niveau mais offre aux participants à ces cours en ligne, au moins pendant la durée de la formation, aussi un échange interactif lui-même riche d'enseignements, comme l'explique **Babar Kamal**, chef de programme à l'UNITAR. Les statistiques internationales sont une matière intéressante pour

de tels cours, en particulier quand elles sont liées aux questions que posent la globalisation économique et financière.

### Pour une vulgarisation et une réflexion de qualité

Il est certes important de disposer de nombreux chiffres, élaborés selon les règles et les codes de déontologie des statisticiens, mais il est tout aussi crucial de «savoir ce qui n'est pas dans les chiffres», a plaidé **Paul Dembinski**, directeur de la fondation de l'Observatoire de la Finance. L'Observatoire de la Finance, dont l'activité est de promouvoir la responsabilité des décisions en finance et par des acteurs financiers, aimerait élargir l'accès aux « faits » dans le cadre d'un projet ambitieux axé sur la présentation et la compréhension, au niveau global et mondial, des statistiques disponibles.

Faute d'une information largement diffusée - et surtout compréhensible par la majorité des utilisateurs de statistiques - les hypothèses posées lors de l'élaboration des données statistiques - des données brutes aux plus sophistiqués des d'indicateurs - sont souvent oubliées, au détriment d'une appréciation fine des chiffres. Le bon mot de David Doyle. « *If we do not count something, it gets ignored. If we do count it, it gets perverted* » prend ici son plein sens. Il existe de nombreuses questions relatives à la signification des statistiques officielles publiées dans cette période d'évolution rapide, comme par exemple comment se fait-il que les prestations de service ne représentent que 19% du commerce mondial alors que leur part dans le produit mondial est de 60% ? Quel rôle joue le commerce inter-entreprise des multinationales? En finances, les changements de techniques financières sont si rapides que les statistiques peinent à suivre et que la trop courte durée des séries ne permet pas une appréciation pertinente des risques.

Pour être à même de mieux analyser des chiffres éclairant des pans négligés de la réalité, l'Observatoire de la finance privilégie dans son projet une approche à trois niveaux pour chaque domaine observé

- la présentation de la signification et des limites du concept observé et mesuré ;
- l'étude des instruments de mesure utilisés par rapport au concept que l'on veut mesurer, en tenant compte des problèmes méthodologiques et de la qualité des sources
- la présentation des tendances récentes en la matière.

La complexité du traitement des données statistiques sur un plan global, mondial, est illustrée par **Claudio Bologna**, collaborateur scientifique à Eco'Diagnostic, Genève, dans le cas des statistiques sur les produits alimentaires de l'Organisation des Nations Unies pour l'alimentation et l'agriculture (FAO):

- la multitude de produits est un obstacle à une présentation synthétique, ce d'autant plus que le nombre de regroupements des produits de catégorie similaire (céréales, viande, etc.) est limité, ou
- l'agrégation géographique, par continent, par régions mondiales se heurte fréquemment à l'absence de données ou à l'existence de données de qualité très variée selon les pays (fiabilité des estimations)
- les possibilités de tracer le produit de la production à la consommation sont limitées selon les pays (en tenant compte des pertes, et des échanges entre pays ou régions).

### Besoin de savoir et protection de la personne

Le Professeur **Denise Lievesley**, présidente de l'Institut International de la Statistique de La Haye, a souligné le double rôle des professionnels de la statistique officielle: respecter la confidentialité de certaines données, telle l'identité des personnes dans la collecte d'informations à caractère médical, tout en favorisant la diffusion la plus large possible des chiffres une fois qu'ils ont été établis en respectant le code de déontologie.

Par ailleurs, les statistiques étant des biens publics produits dans l'intérêt du public, il convient de favoriser une communauté de savoir entre les producteurs de données et les utilisateurs. Parmi ces utilisateurs, les chercheurs universitaires fournissent un feed-back précieux pour améliorer la qualité future des statistiques. Mais, l'éthique des utilisateurs de statistiques est tout aussi importante que celle des producteurs de données primaires. Et les statisticiens s'inquiètent à juste titre d'un mauvais usage des données et des manipulations dans la présentation (telles que des agrégations fantaisistes) qui peuvent induire des erreurs d'interprétation lourdes de conséquences.

### Des statistiques de base aux indicateurs sophistiqués

L'inquiétude quant à la véritable signification des chiffres produits à partir des statistiques officielles est particulièrement présente dès qu'il s'agit de construire des indicateurs agrégés et sophistiqués. Au-delà de la controverse qui existe sur la signification même du terme « compétitivité », le « Rapport sur la compétitivité des pays » publié chaque année par le World Economic Forum (WEF) est un exemple d'une construction complexe d'un indicateur largement diffusé et commenté dans les médias, sans toujours rendre compte des détails, souvent fastidieux il est vrai, de son élaboration.

Le classement des pays est établi, dans la pure tradition de « benchmarking », explique **Irène Mia**, économiste senior de cette organisation, en prenant en compte à la fois des données tirées des statistiques nationales et internationales, et les résultats d'une enquête menée auprès de quelque 11 000 décideurs du monde entier pour mesurer les facteurs qualitatifs.

La pondération entre données objectives et appréciations subjectives - pour construire l'indicateur agrégé de compétitivité - varie en fonction du stade de développement du pays analysé. Le WEF a retenu trois stades de développement: « Factor-driven stage », « Efficiency driven stage » et « Innovation-driven stage ». L'agrégation d'une telle quantité de données pose toujours le problème de la signification du « ranking » établi qui dépend d'un grand nombre d'hypothèses et de décisions, par exemple sur la pertinence de tel ou tel facteur ou la pondération données aux facteurs.

Une autre analyse complexe présentée et dont la méthodologie contraste avec celle du rapport sur la compétitivité est celle du « travail décent » analysé depuis quelques années par l'Organisation internationale du travail (OIT). Cette notion souligne qu'un emploi rémunéré n'est pas synonyme de « travail décent » ; ce dernier supposant le respect des normes de l'organisation, tant en matière de conditions de travail que de droits syndicaux. **Sylvester Young**, expert en statistiques au Département de l'intégration de l'OIT, a présenté la réflexion de son organisation en la matière. L'OIT a finalement renoncé à la construction d'un indice statistique composite du « travail décent », au profit d'un suivi régulier des indicateurs des progrès accomplis sur cette voie (opportunités d'emploi taux de participation, emplois informels, taux de chômage, respect des conventions internationales, etc.).

Chef des statistiques à la Conférence des Nations Unies sur le commerce et le développement (CNUCED), et co-organisateur du colloque, **Henri Laurencin** a relevé quelques-unes des difficultés inhérentes à la construction d'indicateurs agrégés, avec des exemples concrets tirés de sa pratique. Du plus simple, comme la vérification de la compatibilité de séries de chiffres - les données sur la Suisse, par exemple, sont parfois élaborées en incluant le Liechtenstein - , ou la rupture des séries suite à des changements de définition des agrégats ou de l'aire géographique, - tel le suivi dans le temps d'anciens pays aujourd'hui éclatés comme l'URSS - , au plus complexe - telle que l'estimation de données manquantes, l'agrégation en un seul indicateur de données hétéroclites ou utilisant des variables auxiliaires comme le taux de change pour la conversion des monnaies. Les difficultés présentes sont nombreuses. Cet expert souligne que si les indicateurs composites permettent de suivre les progrès de différents pays de manière facilement communicable au grand public, sans revenir aux données de base, ils sont également susceptibles d'induire des choix politiques erronés, certaines dimensions de la performance étant ignorées car non mesurées.

#### Les leçons à tirer de la crise actuelle en matière de statistiques financières

Actualité oblige, le colloque international s'est conclu par une table ronde consacrée aux leçons à tirer de la crise actuelle en matière d'élaboration et de diffusion des statistiques financières.

**Andrew Cornford**, économiste, ancien expert de la CNUCED en banque et finances, actuellement associé aux travaux de l'Observatoire de la Finance, a présenté trois thèmes majeurs de discussion qui ont émergé de cette crise financière: le risque systémique, la régulation macro prudentielle et le manque de transparence. Il a plaidé pour la mise en place d'indicateurs d'alerte précoces sur les risques bancaires. Même si l'entrée en vigueur des normes de Bâle II va grandement améliorer l'information disponible sur les risques propres à chaque établissement bancaire, il conviendrait, selon lui, de faire plus; notamment en instaurant un suivi du risque de l'effet de levier dont cette crise a montré l'important potentiel destructeur dans les actifs des banques.

Un souci partagé par **Paul van den Berg**, responsable de l'information du Département des statistiques de la Banque des règlements internationaux (BRI). Il a relevé que jusqu'au déclenchement de la crise en cours il n'y avait pas eu une réelle demande pour améliorer les indicateurs statistiques existants ou en créer de nouveaux. Ce qui n'a pas empêché les Banques centrales et les gouvernements de devoir régulièrement lutter pour obtenir des données fiables en temps voulu. A l'avenir, ces mêmes Banques centrales devraient, entre autres, s'employer à rendre opérationnels et quantifiables un certain nombre de nouveaux concepts tels que la liquidité du marché, l'effet de levier, l'aversion ou l'appétit pour le risque et même la stabilité financière. Il reconnaît toutefois que les nombreuses statistiques et données existantes n'ont pas toujours été interprétées correctement.

Directrice du Département des statistiques du Fonds Monétaire International (FMI), **Adelheid Burgi-Schmelz**, a pour sa part relevé que le FMI avait déjà mis au point des Indices de Solidité Financière (ISF) pour les grands groupes bancaires. Ces indices gagneraient toutefois à être améliorés par une meilleure prise en compte des opérations hors bilan des banques. Cette crise ayant pris racine dans les marchés de produits dérivés et titrisés, créés justement par les établissements financiers pour sortir du risque de leurs bilans.

La communauté internationale des statisticiens devra ainsi se pencher à l'avenir sur le transfert des risques de crédit à travers les instruments de couverture des risques de défaut ou par l'intermédiaire des dérivés de crédits. Un meilleur suivi des risques de liquidité, de levier et de refinancement devrait également être instauré. Le FMI travaille aussi à la mise au point d'indicateurs de risques synthétiques.

Toutes ces innovations à venir sur le front des statistiques ne permettront toutefois de mieux prévenir une prochaine crise d'envergure que si des efforts de formation en matière d'analyse des statistiques orientés vers les chercheurs universitaires, mais aussi vers les décideurs politiques et économiques, sont poursuivis de concert.

(2'727 mots)

## Les leçons pour l'Observatoire de la Finance

Dans son analyse du système financier et du comportement des acteurs concernés, l'Observatoire est soucieux de baser sa réflexion sur des données, des observations et des faits, que ce soit à travers les discussions qui ont lieu au sein des divers groupes de travail qu'il anime, ou lors de la rencontre internationale de Bossey organisées chaque année, ou encore dans ses diverses publications lorsqu'il tente de comprendre l'évolution du système financier. Très tôt est apparu le problème de la lisibilité et de la compréhension des statistiques internationales, ce qui a conduit l'Observatoire à publier en 2003, en anglais et en français, un premier ouvrage de référence intitulé *Economie et finance globales, la portée des chiffres*<sup>1</sup>. Cet ouvrage se penche sur l'évolution de l'économie et de la finance mondiale, basée sur la mise en valeur et l'explication des statistiques internationales.

Le colloque international qui a été organisé dans le cadre de la révision et de l'extension de cette étude, avec l'aimable soutien du RUIG, a débouché sur un certain nombre de constats qui sont autant d'encouragement pour continuer l'effort dans la direction d'une vulgarisation intelligente de la production statistique. Ces constats, dans lesquels les intervenants et les participants du colloque se sont largement reconnus, sont les suivants :

- Un progrès indéniable a été réalisé pour conforter et améliorer la fiabilité et la qualité des statistiques, tant par les organisations internationales qui tentent d'harmoniser les définitions et de développer l'outil statistique que par les responsables statistiques nationaux.
- Les crises posent toujours la question de la pertinence des statistiques disponibles. A trop se focaliser sur les chiffres disponibles, on risque de passer à côté de l'essentiel, c'est-à-dire des conditions précises de leur élaboration. Toujours plus de chiffres ne permettent pas de faire l'économie des concepts permettant de les décrypter.
- Les statisticiens producteurs sont soucieux de la fiabilité et de la qualité des données et ont jusqu'à très récemment négligé la mise en valeur de leur travail auprès des non spécialistes : celle dernière peut passer par l'explication des concepts et des mesures à la production d'illustrations (tableaux, graphiques) parlantes et pertinentes<sup>2</sup>.
- Si cet effort de mise en valeur et d'explication est déjà entamé, il s'avère que le contact direct entre professionnels de la statistique et usagers académiques, professionnels et décideurs politiques ou économiques ne s'est pas encore développé, faute peut-être d'un langage commun et d'une approche concertée.
- La bonne compréhension de la production statistique par les usagers est importante aussi aux yeux des producteurs qui s'inquiètent d'un mauvais usage des données. Certaines manipulations des données et une mauvaise présentation peuvent avoir des conséquences dramatiques pour la prise de décision à quel que niveau que ce soit.

---

<sup>1</sup> <http://www.obsfin.ch/economic-and-financial-globalization.htm>

<sup>2</sup> Voir par exemple le cas de l'OCDE, avec le site ECDEeXplore présenté lors du colloque. Voir aussi Understanding Economic Growth, Macro-level, Industry-level, Firm-level, OCDE 2004; Enrico Giovanni, Understanding Economic Statistics. An OCDE perspectives, OCDE, 2008 ou encore le Factbook annuel

L'Observatoire de la Finance, avec ses modestes moyens et les moyens encore à trouver, va continuer à contribuer à jeter un pont entre les producteurs et les professionnels de la statistique et le cercle le plus large possible d'utilisateurs. Les actions à court et moyen termes suivantes sont envisagées:

- création et développement d'un site ressources sur les statistiques internationales focalisé sur les domaines économiques et financiers, avec la collaboration des organisations internationales. La révision de l'étude de 2003 est publiée sur le site sous une forme adaptée à Internet, avec d'autres contenus originaux produits par l'Observatoire ;
- engagement dans un effort d'analyse et d'interprétation de la globalisation économique et financière à l'aide de l'outil statistique à travers le e-learning et d'autres instruments d'apprentissage ;
- organisation de séminaires réunissant producteurs, diffuseurs et utilisateurs des statistiques internationales, avec l'organisation en 2011 d'une conférence de suivi du colloque de juin 2009.

L'objectif à plus long terme est de créer un Centre de compétences, basé à Genève, sur l'analyse de la globalisation économique et financière. Le cœur de l'activité de ce Centre serait la mise en valeur des statistiques internationales susceptibles d'éclairer, de plusieurs points de vue, le phénomène de globalisation.

Mots : 657