

L'État, le marché et les statistiques

Cinq façons d'agir sur l'économie

Depuis le XVIII^e siècle, l'histoire de la science économique a été scandée par des débats sur les relations entre l'État et le marché. Doctrines et politiques, plus ou moins liées entre elles, se sont succédées. Leurs interactions ont été analysées du point de vue des idées et des pratiques institutionnelles associées à quelques configurations historiques stylisées : mercantilisme, planisme, libéralisme, État providence, keynésianisme, néolibéralisme. Par ailleurs, quelle que soit l'orientation dominante, des systèmes d'observation statistique ont été peu à peu construits par les divers États. Mais la croissance de ces systèmes statistiques a été en général présentée comme une sorte de progrès inéluctable et presque univoque, peu connecté avec l'évolution des doctrines et des pratiques (pourtant très diversifiées) de direction ou d'orientation de l'économie par l'État. Les ouvrages sur l'histoire de la pensée économique, ou même, plus précisément, sur l'histoire des interactions réciproques entre l'État et la connaissance économique, insistent peu sur les particularités des modes de description statistique spécifiques aux différentes configurations historiques de relations entre l'État et le marché. En un mot, ces deux histoires, celle des politiques économiques, et celle de la statistique, sont rarement présentées et surtout problématisées *ensemble*.

La cause de la quasi-absence de cette histoire dans les travaux sur l'histoire économique est simple. La statistique y est perçue comme un instrument, une méthodologie subordonnée, un outil technique fournissant une validation empirique aux recherches économiques et à leurs

usages politiques. Dans cette conception linéaire du progrès de la science et de ses applications, la statistique (en tant que production de données et en tant qu'outil mathématique d'analyse de celles-ci) ne peut évoluer que de façon autonome par rapport aux doctrines et aux pratiques économiques. C'est pour cette raison que, dans les ouvrages d'histoire de la pensée ou des faits économiques, cet aspect est peu traité, et n'est, en tous cas, jamais envisagé comme problématique et éventuellement contradictoire, c'est-à-dire digne d'un développement historique spécifique.

Par « statistique », on entend bien sûr ici l'ensemble formé par la mise en forme, l'enregistrement et l'analyse de données quantitatives, sous forme de séries, d'indices, de modèles économétriques et de beaucoup d'autres outils aujourd'hui disponibles dans les banques de données et les « packages » informatiques.

Un fil conducteur de l'analyse des relations entre l'outil statistique et son contexte social et cognitif est fourni par l'histoire des façons de penser le rôle de l'État dans la direction de l'économie.

Pour cela sont présentées ici, de façon très simplifiée, cinq configurations jugées typiques.

L'intervention directe englobe des perspectives très variées, allant du mercantilisme et du colbertisme jusqu'aux économies planifiées socialistes : l'« État ingénieur » à la française est une de ses modalités.

À l'opposé, *le libéralisme classique* réduit au minimum cette intervention

et prône la libération des forces du marché.

L'État providence cherche à protéger les travailleurs salariés des conséquences de l'extension de la logique marchande au travail lui-même.

Le keynésianisme assigne à l'État une responsabilité dans le pilotage macroéconomique d'une société dont le caractère marchand n'est cependant pas contesté.

Enfin, *le néo-libéralisme* envisage un État prenant appui sur les dynamiques microéconomiques, en les orientant éventuellement par des systèmes d'incitation et en acceptant les principales hypothèses de la théorie des anticipations rationnelles.

Ces cinq configurations ne correspondent pas à une succession historique et ne sont pas exclusives les unes des autres. Elles sont même souvent entremêlées dans des situations concrètes. Elles n'ont été ainsi stylisées que pour proposer une grille de lecture différenciée de l'histoire des outils statistiques utilisés dans chacun de ces cinq cas.¹

¹ Pour une étude historique de la statistique publique, voir, pour les États-Unis : Margo Anderson, *The American Census, A Social History* (New Haven : Yale University Press, 1988) ; Joseph Duncan and William Shelton, *Revolution in United States Government Statistics, 1926-1976* (Washington : US Department of Commerce, 1978) ; pour la Grande-Bretagne : Roger Davidson, *Whitehall and the Labour Problem in Late-Victorian and Edwardian Britain, A Study in Official Statistics and Social Control* (London : Croom Helm, 1985) ; et, pour une comparaison entre la France, la Grande-Bretagne, l'Allemagne et les États-Unis : Alain Desrosières, *La politique des grands nombres, Histoire de la raison statistique* (Paris : La Découverte/Poche, 2000).

L'État ingénieur : la production et les hommes

Cette configuration a une longue histoire. L'État se substitue directement, pour des raisons variées, à l'initiative privée. Colbert a fondé, dans la France du XVIII^e siècle, des manufactures royales, pour la construction navale et la tapisserie. Pierre le Grand a créé une industrie en Russie. L'École polytechnique française formait des « ingénieurs d'État » (mines, ponts et chaussées, armement) habitués à diriger des pans entiers de l'économie en privilégiant largement des logiques techniques plutôt que marchandes².



Jean-Baptiste Colbert, 1619-1688

2. Pour une comparaison du rôle social des ingénieurs d'État français avec celui des membres du « corps des ingénieurs » américain, voir Théodore Porter, *Trust in Numbers, The Pursuit of Objectivity in Science and Public Life* (Princeton : Princeton University Press, 1995). Ce livre montre notamment comment les ingénieurs américains ont une position moins « légitime » que leurs homologues français, dans la mesure précisément où l'État fédéral américain est moins « ingénieur » (au sens analysé ici) que l'État français, et plus orienté par les principes du marché.

3. Ainsi Lénine a été particulièrement intéressé par les méthodes d'organisation du travail de l'ingénieur américain Taylor, basées sur l'analyse quantitative et le contrôle rigoureux des temps nécessaires à la production.

4. Cette technique, née aux États-Unis dans les années 1930, puis en Europe dans les années 1940, était alors souvent désignée sous le nom de « calcul du revenu national ». À ce sujet voir : J. Kendrick, « The Historical Development of National-Income Accounts », *History of Political Economy*, 2, 1970, pp. 284-315, et A. Vanoli, *Histoire de la comptabilité nationale*, La Découverte, Paris, à paraître.

5. L'économiste et démographe français Alfred Sauvy (qui n'était pas marxiste) a longtemps proposé d'utiliser *les heures de travail* et non la monnaie pour dresser cette comptabilité des échanges interindustriels.

Le rôle de ces ingénieurs a été théorisé par Claude Henri de Saint-Simon (1760-1825), fondateur d'une école de pensée industrialiste, centrée sur la science et la technique, qui a été une des racines lointaines de l'économie marxiste et de la planification centralisée du monde soviétique³.

Certaines circonstances historiques sont particulièrement favorables au développement d'un État directement organisateur de l'économie. Les deux guerres mondiales ont impliqué, pour tous les pays belligérants, une concentration poussée et une standardisation systématique des ressources, notamment dans les industries d'armement. Le « Manhattan Project », à l'origine de la bombe atomique, a été un cas typique de cette intervention directe de l'État, dans un pays pourtant réputé pour sa réticence à cette forme d'intervention économique. De même, les moyens alloués à la NASA, dans les années 1960, ne s'expliquent que par la confrontation entre les USA et l'URSS. Ainsi, même les pays les plus favorables à l'économie de marché ont connu, dans certains cas, des formes d'action économique directe de l'État.

La grande crise des années 1930 a été souvent perçue, à l'époque, comme une crise de l'économie de marché classique. Elle a été à l'origine de réflexions et de propositions nouvelles sur le rôle de l'État. Ces idées peuvent, en simplifiant, être réparties en deux groupes : le planisme et le keynésianisme. L'idée de *plan*, bien sûr poussée à l'extrême et réalisée dans le cas de l'Union soviétique, a été pourtant, dans les années 1930, discutée par des économistes et des philosophes politiques répartis sur tout l'éventail politique, de la droite corporatiste à la gauche socialiste, en passant par des réformateurs chrétiens, catholiques ou protestants, notamment en Europe occidentale. Le point commun à ces courants de pensée, par ailleurs très différents, était une hostilité au libéralisme économique, fondée, selon les cas, sur des bases nationalistes, humanistes ou marxistes. En cela, le planisme se distinguait du keynésianisme qui, lui, ne mettait pas en cause l'économie



Karl Marx, 1818-1883

marchande. Bien sûr, en pratique, les deux thématiques, planiste et keynésienne, ont été mêlées après 1945, dans des proportions variables, dans certains pays européens comme la France, les Pays-Bas ou la Norvège. Mais cette distinction analytique est utile pour suivre le développement des statistiques et des modèles économiques utilisés pendant cette période des années 1940 à 1980.

Pour comprendre cela, on peut citer une phrase prononcée par certains des économistes qui, dans les années 1940, ont jeté les bases des systèmes de *comptabilité nationale*⁴ : « On peut considérer l'économie d'un pays comme celle d'une seule grande entreprise. » Bien sûr souvent formulée à des fins pédagogiques, cette phrase est pourtant significative d'une conception *technique* d'une économie et d'une comptabilité nationale dont l'outil principal était le *Tableau des échanges interindustriels* (ou Tableau de Léontieff), comparable au tableau des flux de biens entre les ateliers d'une même entreprise. Ces mêmes économistes défendaient aussi l'idée que leur construction pouvait être utilisée aussi bien dans des économies capitalistes ou socialistes, qu'elle était neutre de ce point de vue. En effet, ce qui importait pour eux était la production et la circulation de biens et services, dont la représentation monétaire, issue du système des prix, n'était qu'une commodité permettant le calcul des agrégats macroéconomiques⁵. Dans cette perspective, les volumes produits et

consommés étaient les grandeurs essentielles pour un « État ingénieur » qui se pensait comme directement responsable de la satisfaction des besoins, de même que le directeur technique d'une entreprise se préoccupe des approvisionnements nécessaires à sa production.

À partir de cet exemple, apparaît la spécificité historique de la statistique nécessaire à l'État ingénieur, comparable à l'information indispensable au général d'une armée : des quantités produites et consommées, des équipements, et enfin, non le moindre des besoins, celui des hommes. Les variables démographiques, la natalité, l'immigration, font partie des soucis d'un tel État, dont la France, inquiète de sa population, a longtemps fourni un cas typique. En revanche, les données plus directement liées au caractère *marchand* de l'économie n'étaient pas centrales dans une telle statistique. C'est même sur ce point que, dans les années 1930 et 1940, les économistes libéraux portaient, à la suite de Friedrich Hayek, leurs plus vives critiques contre les économies planifiées : comment assurer une allocation optimale des ressources en l'absence des informations révélées par les prix de marché ? Certains économistes socialistes, comme Oskar Lange, tentèrent d'imaginer un système de planification capable de « mimer le marché », combinant ainsi les avantages supposés des deux systèmes⁶.

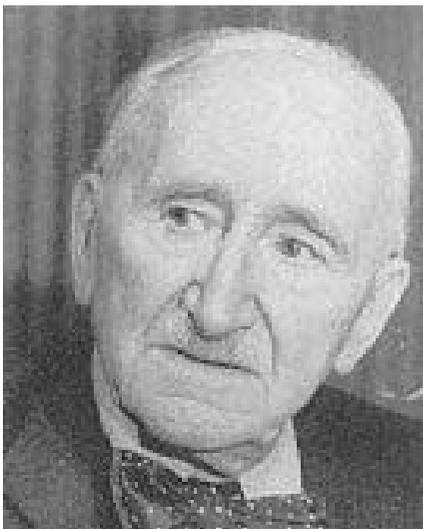
L'organisation de la statistique d'un tel système hybride aurait été fort complexe. Dans le cas des pays du « socialisme réel » d'avant 1989, les prix étaient, de fait, largement arbitraires. Le système statistique était constitué, pour l'essentiel, par une remontée des comptabilités en volume des unités de production vers un centre chargé de suivre l'exécution du plan. Dans le cas français, en revanche, la conception planiste n'a jamais existé de façon pure, et a été combinée, dès les années 1950, à une conception keynésienne clairement affichée⁷.

D'une certaine façon, cette conception « planiste » de la statistique en constitue le cœur historique, puisque, à son origine, cette « science de l'État » produisait les informations directement nécessaires au Prince, pour organiser la levée des armées et la collecte des impôts, dans une conception régaliennne et mercantiliste de cet État. La population, la production des richesses agricoles et industrielles, étaient les premières questions auxquelles ont répondu les fondateurs de l'« arithmétique politique » du XVIII^e siècle. Mais aussi, dès cette époque, apparaissaient, en France avec Turgot et les physiocrates, en Grande-Bretagne avec Adam Smith, une autre conception des relations entre l'État et le marché, le libéralisme économique, puis, plus tard, une autre forme de statistique, cohérente avec celui-ci.

L'État libéral⁸ : le commerce et les prix

Dans sa formulation la plus pure et abstraite, la théorie du marché n'implique pas nécessairement une information statistique. Les prix, révélés par le jeu des échanges marchands et de la concurrence entre producteurs, portent en eux toute l'information indispensable au déploiement des vertus supposées de cette forme d'organisation économique, sans qu'une instance centrale, étatique ou non, n'ait à s'en mêler, notamment en produisant une information statistique. De fait, l'existence de services statistiques permanents a longtemps été contestée, par exemple aux États-Unis, par ceux-là même qui refusaient toute action de l'État dans l'économie. De leur côté, les théoriciens de l'économie de marché, comme Jean-Baptiste Say, Augustin Cournot ou Léon Walras, ont été, eux aussi, réticents à l'utilisation de statistiques économiques pour étayer leurs développements hypothético-déductifs⁹. Alors que la statistique est centrale pour l'État ingénieur, son existence est presque paradoxale pour l'État libéral pur, si celui-ci est seulement imaginable.

Pourtant, nombreuses ont été les institutions et les opérations statistiques directement justifiées par les besoins d'une économie marchande. Les premiers exemples en ont été fournis par l'existence du commerce international, des tarifs douaniers,



Friedrich August von Hayek, 1889-1992
Prix Nobel d'économie 1974

6. Sur cette controverse, voir : Bruce Caldwell, « Hayek and Socialism », *Journal of Economic Literature*, Vol. XXXV (December 1997), pp. 1856-1890.

7. Cette histoire est analysée en détail par François Fourquet, *Les comptes de la puissance, Histoire de la comptabilité nationale et du Plan* (Encres-Recherches, Paris, 1980).

8. Le mot « libéral » est employé ici au sens européen de « favorable à l'économie de marché », et non au sens américain, presque opposé, de « favorable à l'intervention de l'État ».

9. Claude Ménard, dans « Trois formes de résistance à la statistique : Say, Cournot, Walras » (in *Pour une histoire de la statistique*, tome 1, Insee-Economica, Paris, 1987, pp. 417-429), donne de cette réticence une interprétation en termes de préférence scientifique. Mais celle-ci rejoint, de fait, la conception d'un État intervenant le moins possible dans la gestion de l'économie, notamment à travers la production de statistiques.



Adam Smith, 1723-1790

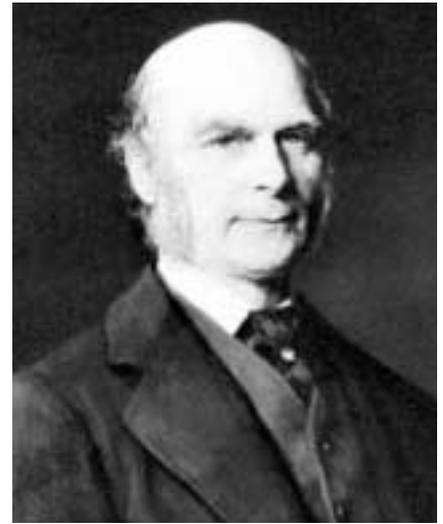
des taux de change et de la gestion nationale des monnaies. Le bureau de statistique du *Board of Trade* anglais a été créé en 1833, au moment précisément où intervenait un ensemble de réformes politiques et économiques visant à libérer complètement le marché capitaliste des entraves diverses héritées du passé (comme la loi sur les pauvres de Speenhamland de 1795). Un des enjeux importants des débats de cette époque était la *Corn Law*. Fallait-il libérer les importations de grains de tout tarif douanier ? Les industriels y étaient favorables car cela permettait de comprimer les salaires, dont la plus grande partie était utilisée à la nourriture des ouvriers. Mais les agriculteurs (et les industriels qui leur étaient proches) y étaient bien sûr hostiles. La discussion de telles questions nécessitait une documentation statistique *ad hoc* sur les prix et les salaires. Ainsi le libéralisme « réel » (et non pas seulement théorique) impliquait un État jouant un rôle d'organe d'intelligence économique, rassemblant et diffusant l'information dont les agents ont besoin pour agir dans le marché.

Aux États-Unis, vers la fin du XIX^e siècle, les débats sur la concentration des grandes firmes et sur les lois anti-trusts offraient un autre exemple, paradoxal lui aussi, de la nécessité d'une intervention de l'État pour que jouent à plein les avantages du marché concurrentiel, revendiqués par les apôtres de celui-ci. Là encore, des statistiques précises sur le fonctionnement des marchés étaient nécessaires pour que de telles lois puissent être rédigées, puis appliquées. La philosophie des législations contre les ententes et les cartels était radicalement différente de celle de l'État ingénieur. Là où celui-ci recherchait des baisses des coûts de production par des économies d'échelles résultant de la standardisation et de la concentration des productions, l'État libéral, au contraire, attendait une baisse de ces mêmes coûts de la concurrence entre des

entreprises dont aucune ne devait être à même de dominer complètement un marché. À ces deux philosophies opposées correspondaient des systèmes statistiques très différents. Le premier était fondé sur des coefficients techniques et des fonctions de production, et, plus généralement, sur une analyse interne des firmes, alors que le second était centré sur les échanges marchands eux-mêmes, et sur les effets des variations des prix sur les comportements des vendeurs et des acheteurs. On voit bien, sur cet exemple, une *co-construction* d'une philosophie de la politique économique et d'un système cognitif d'information statistique, qui ne peut pas être vu comme purement technique et exogène par rapport aux questions soulevées dans un contexte historique précis.

Il arrive que la régulation économique et sociale d'un marché soit jugée impossible sans la production régulière et intense de données statistiques ensuite largement diffusées. Ce fut le cas, aux États-Unis, dès la fin du XIX^e siècle, avec la *statistique agricole*. Il s'agissait alors de recueillir, de centraliser et de mettre en forme, puis de diffuser le plus rapidement possible les informations sur les tendances des récoltes. La connaissance commune ainsi partagée par les vendeurs et les acheteurs devait permettre que s'établissent des prix les plus homogènes et les moins erratiques sur tout le territoire national afin de garantir, si possible, les revenus des producteurs. Des systèmes très élaborés, comme des enquêtes par sondage sur les prévisions de récolte, ont été mis en place, dès les années 1920, puis développés jusqu'à nos jours. Là encore, la transparence du marché était bien l'objectif essentiel de cette statistique. Mais elle pouvait aussi être lue d'une autre façon, du point de vue de la protection sociale des agriculteurs, notamment des plus faibles, contre les effets d'une concurrence sauvage et aveugle.

Ceci annonçait la montée, vers la fin du XIX^e siècle, d'une autre modalité d'intervention de l'État dans la direction de l'économie. *L'État providence*



Sir Francis Galton, 1822-1911

devoir assurer, selon l'expression de Karl Polanyi¹⁰, l'« autodéfense de la société » contre les ravages entraînés alors par le libre marché du travail, de la terre et de l'argent.

L'État providence : le travail salarié et sa protection

Presque en même temps dans tous les pays industriels, dans les années 1880 et 1890, ont été créés des « Offices du travail », ou des « Bureaux de statistique du travail ». Ces innovations institutionnelles terminaient un siècle de débats sur la pauvreté. La croissance rapide de l'industrie avait concentré dans les villes des ouvriers d'origine rurale, en Angleterre et aux États-Unis, souvent immigrants d'Europe dans ce dernier cas. Les situations d'extrême pauvreté qui en avaient résulté étaient en général traitées par la charité et l'assistance locale, jusqu'à ce que l'ampleur du problème ait entraîné un bouleversement complet des façons de penser et de traiter ces questions. Lié à la grande crise économique des années 1875 à 1895, ce renouvellement a été fait dans deux directions très différentes qui, toutes deux, auront ensuite des conséquences importantes et irréversibles sur le développement des méthodes statistiques. Le premier courant, l'eugénisme d'inspiration darwinienne de Francis Galton et Karl Pearson, cherchait les causes et les remèdes des situations de pauvreté dans une théorie biologique des aptitudes individuelles,

10. Voir Karl Polanyi, *La grande transformation : aux origines politiques et économiques de notre temps*, Gallimard, Paris, 1983.



Karl Pearson, 1857-1936

pensées comme innées et héréditaires. La « qualité » de la population était supposée pouvoir être « améliorée » par une sélection, comparable à celle pratiquée dans l'élevage des animaux. Ces idées ont presque complètement disparu (sauf chez quelques groupes marginaux). Mais elles ont été à l'origine des premières formulations élaborées de la statistique mathématique (corrélation, régression, tests) dans le cadre d'une « biométrie » alors eugéniste¹¹. À partir des années 1910, ces mêmes formalismes statistiques ont été repris par des économistes (Henry Moore aux États-Unis, Marcel Lenoir en France) et utilisés dans ce qui deviendra, en 1930, *l'économétrie*¹².

À l'opposé du premier, le second courant cherchait les causes et les remèdes de la pauvreté non dans la biologie, mais dans la société et dans la loi. La force de travail fait désormais l'objet d'un marché. Son prix est le salaire. Si ce marché très particulier n'est pas régulé et protégé par un droit spécifique, le monde ouvrier ne pourra pas sortir de la précarité et du dénuement où l'a plongé le capitalisme au XIX^e siècle. Seul l'État pouvait construire ce système de protection, à partir de lois sur les retraites, le chômage, les accidents du travail et l'assurance-maladie. Les « Offices du travail » créés entre 1880 et 1900 exploraient et mettaient en forme cette nouvelle forme d'État, qualifié plus tard d'État providence. Le *Bureau international du travail* (BIT), créé en 1920, rassemblait et co-

ordonnait les travaux statistiques et juridiques menés dans les divers États.

Pendant cette période des années 1880 à 1930, la statistique du travail a constitué le moteur du renouvellement de la statistique publique, tant pour les grandeurs étudiées que pour les méthodes d'investigation. Les salaires, l'emploi et le chômage, l'activité par profession, les budgets ouvriers, l'indice des prix à la consommation ont désormais fait partie des grandeurs jugées sociales, c'est-à-dire relevant d'une intervention de l'État, notamment sous forme législative. Elles ont été intégrées dans l'agenda des bureaux de statistique. Pour les mesurer, de nouvelles formes d'enquêtes, portant sur des *échantillons représentatifs*, ont été imaginées. Auparavant, les recensements exhaustifs et les fichiers de la gestion courante de l'administration étaient les seules sources statistiques. L'idée de sondage probabiliste, impliquant celle d'*approximation*, était encore, au XIX^e siècle, jugée contraire à l'exigence de rigueur et à la confiance à attendre d'une statistique qui, bien que liée à l'État, était pourtant peu légitime dans l'opinion.

Or, au nouvel État providence, est associée l'idée d'*assurance*. Une procédure basée sur un calcul statistique assure la couverture des risques, sur la base des probabilités (mesurées par des fréquences) des divers événements décrits par la nouvelle sta-



Adolphe Quételet, 1796-1874

tistique du travail. Ainsi cet État providence est un État probabiliste. Il prend appui sur l'intuition centrale d'Adolphe Quételet : les grandeurs agrégées, résumées par des moyennes, ont des propriétés de stabilité et de prévisibilité qui font défaut aux individus. Ceci est la justification du mécanisme de l'assurance. Par ailleurs, la population étant traitée de façon uniforme selon les mêmes lois au niveau national, il est cohérent de la considérer comme une urne probabiliste dans laquelle sont puisés des échantillons. Les mesures effectuées dans ceux-ci peuvent être extrapolées à la population entière, moyennant une incertitude mesurée par un « intervalle de confiance ». Ainsi les philosophies politiques et les schèmes cognitifs de l'État providence sont-ils étroitement imbriqués. Ont été construites en même temps une nouvelle forme de l'État et une nouvelle façon de faire des statistiques.

L'État keynésien : la demande globale et ses composantes

La crise économique des années 1880 avait eu pour conséquence de placer les questions de la protection du *travail salarié*, et donc celle de sa connaissance statistique, sur l'agenda de la puissance publique, donnant naissance aux premières formes de l'État providence, notamment en Allemagne avec les lois de Bismarck. La crise des années 1930 a eu des conséquences semblables, mais, cette fois, pour l'équilibre macro-économique entre une « offre globale » et une « demande globale », portant sur *l'ensemble des biens et des services*. L'important est que l'idée d'une régulation centralisée de cet équilibre par l'État a non seulement été formulée en théorie (par Keynes en 1936),

11. Voir Donald Mackenzie, *Statistics in Britain, 1865-1930. The Social Construction of Scientific Knowledge* (Edinburgh : Edinburgh University Press, 1981), et Michel Armatte, *Histoire du modèle linéaire. Formes et usages en statistique et économétrie*, thèse de doctorat, EHESS, Paris, 1995.

12. Voir Mary Morgan, *The History of Econometric Ideas* (Cambridge : Cambridge University Press, 1990).



Lord John Maynard Keynes, 1883-1946

mais qu'elle a été rapidement rendue opératoire, grâce aux tableaux de la *comptabilité nationale*, et aux séries décrivant les liens entre les évolutions des diverses composantes de cette offre et de cette demande. Ainsi, là encore, étaient co-construits un État doté d'une responsabilité nouvelle (celle de piloter l'équilibre macroéconomique, tout en respectant le caractère marchand de l'économie) et un mode de description et d'analyse nouveau, la comptabilité nationale et les modèles macroéconométriques, tels que celui construit aux Pays-Bas par Jan Tinbergen (1903-1994), dès les années 1930¹³.

L'innovation essentielle de la perspective keynésienne était de présenter l'économie comme un tout articulé en quelques grands flux macroéconomiques, susceptibles d'être mesurés et reliés dans des tableaux comptables théoriquement cohérents et exhaustifs¹⁴. Directement associé à une forme de politique économique, ce

13. Les relations entre Keynes, la comptabilité nationale et la modélisation macroéconométrique sont moins évidentes qu'il n'est souvent dit. Elles sont décrites de façon vivante par Don Patinkin : « Keynes and Econometrics : on the Interaction between the Macroeconomic Revolutions of the Interwar Period », *Econometrica*, 44, 1976, pp. 1091-1123.

14. Le modèle walrasien envisageait lui aussi l'économie comme un tout systémique, mais ses acteurs microéconomiques étaient des hypothèses théoriques et ne pouvaient recevoir un contenu empirique.

15. Cette comparaison est présentée de façon plus détaillée dans : Alain Desrosières, « La commission et l'équation : une comparaison des plans français et néerlandais entre 1945 et 1980 », *Genèses*, 34, 1999, pp. 28-52.

modèle a été, à partir des années 1950, à l'origine d'une réorganisation complète de la définition, de la mise en forme et de la chaîne de production des variables statistiques. La cohérence d'ensemble et la double contrainte d'équilibre (par agents et par opérations) des tableaux comptables poussaient à identifier les lacunes et les contradictions entre les sources statistiques existant déjà. Plus profondément, ces sources, changeant d'usage, changeaient aussi de nature. Ainsi, par exemple, les enquêtes sur les *budgets des familles* existaient déjà, à une petite échelle, depuis le XIX^e siècle. Elles visaient surtout à décrire les besoins et les dépenses des familles *ouvrières*, dans la perspective de dépense du salaire, typique de la statistique de l'État providence, dont le travail salarié était le cœur. À partir des années 1950, elles devenaient des *enquêtes de consommation*, portant sur toute la population. Elles s'intéressaient aux marchés de tous les biens et services consommés, et non plus au seul marché du travail, comme le faisaient les petites enquêtes d'avant 1940. On voit sur cet exemple qu'une enquête statistique est inséparable de ses *usages*. Ce point est souvent oublié, caché par la division (institutionnelle et cognitive) du travail entre producteurs et utilisateurs des données.

La distinction opérée ici entre « État providence » et « État keynésien » est bien sûr simplificatrice. Du point de vue de l'histoire de l'État, de son rôle dans la « direction de l'économie », et des statistiques associées à cette direction, elle a correspondu à deux étapes distinctes. La première, celle de la protection du travail salarié, a pris forme entre 1880 et 1900. La seconde, celle du pilotage macroéconomique, a émergé entre 1930 et 1950. Mais, à partir de cette dernière date, ces deux formes d'action et de connaissance ont été fortement liées, au moins en Europe occidentale (France, Allemagne et Grande-Bretagne). Les prestations de protection sociale (retraites, assurances maladie et chômage, allocations familiales) sont devenues une composante majeure de la régulation des

revenus des salariés, et donc de la demande globale du modèle keynésien. Pour cette raison, la crise des années 1970 et 1980 n'a pas eu les mêmes conséquences sociales que celle des années 1930, et le chômage y a pris des formes différentes. C'est d'ailleurs aussi la raison pour laquelle ces deux crises ont été pensées de deux façons presque opposées. Celle des années 1930, vue comme une crise de la logique marchande et du « laisser-faire », avait eu pour conséquence un accroissement du rôle de l'État et de la protection sociale. Au contraire, celle des années 1980 a été pensée comme une crise des solutions imaginées cinquante ans plus tôt, le keynésianisme et l'État providence. Elle a conduit à la montée des thèmes néo-libéraux, représentés notamment par Ronald Reagan et Margaret Thatcher, qui, tous deux, diminuèrent les crédits de la statistique publique, au nom de la réduction du rôle de l'État dans la direction de l'économie.

Une comparaison entre les plans français et néerlandais¹⁵

La distinction opérée ci-dessus entre l'« État ingénieur » et l'« État keynésien » peut, elle aussi, être discutée.

Dans le cas de la France des années 1950 à 1970, ces deux formes d'action et de description économique ont été imbriquées. Un « Commissariat général du Plan » a été créé en 1945



Jean Monnet, 1888-1979

par Jean Monnet (qui sera ensuite, dans les années 1950, un des fondateurs du « marché commun européen »).

Ce plan français associait étroitement trois composantes : une prévision des grands investissements (publics et privés) en infrastructures, et des financements *ad hoc*, nécessaires après les destructions de la guerre ; une procédure de consultation et de dialogue entre les acteurs économiques et sociaux dans un cadre de « commissions » spécialisées, distinct du débat parlementaire classique ; et enfin un système d'information et d'analyse économique, centré sur la comptabilité nationale. Cette construction combinait de façon spécifique l'État ingénieur (les anciens élèves de l'École polytechnique y étaient nombreux), l'État keynésien à travers la comptabilité nationale et la forme des analyses macroéconomiques, et enfin un État « social ». Celui-ci était caractérisé par l'expression organisée des groupes sociaux, avec un intérêt poussé pour l'idée de *réduction des inégalités sociales*, et donc pour les enquêtes et indicateurs sociaux permettant de les décrire.

De façon apparemment surprenante, ce réseau social et cognitif français n'incluait pas, jusqu'en 1970, l'usage de modèles macroéconométriques tels que ceux de Jan Tinbergen, ou de Lawrence Klein et Arthur Goldberger¹⁶. Aux Pays-Bas, de tels modèles avaient été utilisés depuis les années 1930. Ces deux pays, France et Pays-Bas, avaient pourtant des points communs. Tous deux, occupés et gravement détruits pendant la guerre, ont créé en 1945 un bureau de planification, alors que les autres grands pays occidentaux (Allemagne, Grande-Bretagne, États-Unis) rejetaient cette idée, jugée contraire à celle de marché, et contaminée par les expériences des pays totalitaires, nazie ou soviétique.

Deux personnages charismatiques étaient à l'origine de ces bureaux, Monnet en France, Tinbergen aux Pays-Bas. La personnalité de ce dernier, auteur en 1936 du premier modèle économétrique, pourrait suffire à expliquer que, dès les années 1950,

le plan néerlandais a développé de nouvelles formes de ces modèles, mais aussi que ceux-ci ont été largement utilisés dans le débat social et



Jan Tinbergen, 1903-1994
Prix Nobel d'économie 1969

politique. Ainsi, au moment des élections aux Pays-Bas, les partis acceptaient que leurs programmes soient soumis à l'épreuve du modèle, et jugés sur leurs résultats en termes de croissance, d'inflation, de chômage et de commerce extérieur.

En France, avant 1970, les débats ne prenaient pas appui sur un modèle économétrique et n'impliquaient pas les partis. Ils se déroulaient dans les « commissions du Plan », et étaient menés dans le langage des ingénieurs et des statisticiens, qui avaient, de fait, tendance à envisager l'économie « comme une seule grande entreprise » et non comme le lieu de la compétition marchande. Placés, en raison de leur appartenance aux « grands corps », en position d'« expertise d'État », ces ingénieurs parlaient plus spontanément le langage de la rationalité technique, symbolisé notamment par le Tableau de Leontieff des échanges interindustriels. Les planificateurs néerlandais, en revanche, étaient souvent des universitaires, plus extérieurs à l'État. Ils travaillaient aussi sur une économie largement tournée vers le commerce mondial depuis des siècles. La dynamique du marché était une évidence pour eux. Les équations du modèle néerlandais cherchaient à simuler cette dynamique,

alors que la procédure française mêlait une vision d'ingénieur et une perspective keynésienne de « statique comparative » (entre le futur souhaité et le passé constaté) servant de support aux discussions des commissions du Plan.

Les Néerlandais s'appuyaient sur l'enchaînement dynamique des fluctuations d'une économie marchande autonome, comme on tente de monter un cheval au galop. La définition des objectifs était conditionnée par une vive sensibilité au cours de cette économie. La procédure de planification impliquait une articulation forte entre les modélisations des objectifs et des moyens, l'accent étant mis sur le *résultat* de la procédure. *Le plan néerlandais mimait le cours de l'économie par les équations de son modèle*. Les Français avaient une vision plus technique et quantitative d'une économie dont la dynamique des prix était restée longtemps mystérieuse. Le cours de cette économie était réduit à son année horizon. En revanche, la procédure sociale de discussion détaillée de cet horizon était privilégiée, à travers un circuit compliqué d'experts, de comptables nationaux, de commissions et de groupes de travail. *Le plan français mimait le cours de l'économie par la négociation entre les groupes sociaux, dans le cadre des commissions*.

L'État néo-libéral : polycentrisme et incitations

Les formes d'État décrites ci-dessus avaient en commun d'être dotées d'un *centre*, y compris dans le cas de l'État libéral, où, par exemple, les statistiques nécessaires à l'application des lois anti-trusts ou à la transparence des marchés agricoles ne pouvaient être que centralisées.

L'État néo-libéral est pensé au contraire comme un ensemble de pôles administratifs ou territoriaux différents, dont les relations sont négociées, contractuelles, réglées

16. Sur l'histoire générale de ces modèles, voir : Ronald Bodkin, Lawrence Klein and Kanta Marwah (eds), *A History of Macroeconometric Model-Building* (Aldershot : Edward Elgar, 1991).

par le droit. Les États fédéraux ou les unions d'États souverains comme l'Union européenne offrent des exemples variés de telles modalités. Celles-ci sont fondées sur les notions de subsidiarité, d'action procédurale, de négociation et de réseau¹⁷. Le plus de liberté possible est laissé aux niveaux élémentaires de la société, en ne confiant aux niveaux supérieurs que les pouvoirs que ne peuvent assurer les premiers. L'action procédurale édicte des modalités de négociation et de décision et non pas des règles substantielles. Les lieux d'action, de décision, et par là de production et d'usage de l'information, sont nombreux et reliés entre eux de façons variées. Les domaines considérés comme relevant d'une responsabilité collective sont multipliés : environnement, bioéthique, enfance maltraitée, toxicomanie, prévention du sida et d'autres nouvelles maladies, protection des minorités culturelles, égalité entre hommes et femmes, sécurité des équipements domestiques et industriels, normes de qualité des biens de consommation. Dans chaque cas sont élaborées et négociées *simultanément* des modalités de jugement et de mise en forme statistique de ces problèmes, des répartitions des responsabilités entre les divers acteurs, des façons d'évaluer *a posteriori* les actions

publiques, et de transformer celles-ci en fonction de ces évaluations. Des informations sont produites et utilisées dans tous les maillons de cette chaîne circulaire de la description, de l'action et de l'évaluation.

L'action publique intervient plus par des incitations que par des règlements. Ces incitations, par exemple fiscales, sont pensées dans les termes de la théorie microéconomique : comportement de l'agent individuel rationnel, préférence, utilité, optimisation, externalités. Un exemple typique de cette forme de législation fondée sur des justifications issues de la microéconomie est la création d'un *marché des droits de polluer*, supposé plus efficace que des règlements fixant des seuils de pollution à ne pas dépasser. L'évaluation de telles procédures incitatives peut être faite par des études sur données individuelles ou par des quasi-expérimentations, visant à mesurer et modéliser les comportements des acteurs, *y compris ceux qui participent à la puissance publique*. Ce dernier point constitue une des principales différences entre cet État néolibéral et les précédents. Il résulte notamment de la diffusion des idées issues de la théorie des *anticipations rationnelles*. Celle-ci soutient que les politiques publiques (du moins celles qui ne sont pas des réponses directes à des chocs inattendus) finissent par échouer dès lors que les acteurs intègrent, dans les informations orientant leurs comportements, les effets anticipés de ces décisions publiques¹⁸. Dans cette perspective, aucun acteur, notamment l'État, n'est extérieur au jeu. L'État se démultiplie en plusieurs « centres de direction ». Ceux-ci sont des acteurs parmi d'autres, relevant des mêmes

formes de modélisation, économique ou sociologique, que n'importe quel autre acteur microéconomique.

L'idée, suggérée au début de ce texte, d'endogénéiser la construction de l'outil statistique par rapport à l'analyse historique des formes de l'État, est, d'une certaine manière, cohérente avec ce qui précède, même si une telle historicisation des pratiques statistiques ne fait pas partie de la boîte à outils des théoriciens de l'économie. En effet, dans une conception réaliste de la statistique, qui a longtemps prévalu, celle-ci était un simple instrument de mesure, extérieur à une « réalité » qui lui préexistait, de la même façon que l'État critiqué par les partisans des anticipations rationnelles était extérieur à la société. Dans la mesure où la production de connaissance statistique est une composante essentielle de la « direction de l'économie », il n'est pas surprenant que la démultiplication et l'endogénéisation des comportements des différents « centres de direction », quels qu'ils soient, s'accompagnent d'une démultiplication et d'une endogénéisation analogues des « centres de calcul » producteurs des « données » statistiques. Celles-ci ne sont jamais « données », mais résultent d'un processus social coûteux, dont les composantes, tant cognitives qu'économiques, font partie intégrante de la société globale qu'elles sont supposées décrire.

Alain DESROSIÈRES
Insee
Direction générale
Chef de la division
Méthodes comparées

17. Certains de ces aspects de l'État néolibéral sont bien décrits par Robert Nelson, « The Economics Profession and the Making of Public Policy », *Journal of Economic Literature*, Vol XXV, March 1987, pp. 49-91.

18. Voir David K. H. Begg, *The Rational Expectations, Revolution in Macroeconomics Theories and Evidence* (Oxford : Oxford University Press, 1982). Pour une histoire des origines de cette forme de raisonnement, voir Albert Hirschman, *The Rhetoric of Reaction, Perversity, Futility, Jeopardy* (Harvard : Harvard College, 1991).

La version originale de cet article, ici remanié, avait été écrite pour le Cambridge History of Science.

| | Façons de penser la société et l'économie | Mode d'action | Formes de statistiques et de modélisations |
|---|---|--|--|
| Etat ingénieur La production et les hommes (depuis le 17 ^e siècle) | Institution hiérarchisée et organisée rationnellement France de Colbert à De Gaulle URSS | Optimisation sous contrainte. Réduction des coûts. Planification. Technocratie. Grands travaux. Vision à long terme. | Démographie. Production en quantité physique. Tableaux d'échanges interindustriels. Balances matières. |
| Etat libéral Le commerce et les prix (depuis le 18 ^e siècle) | Etat minimum Physiocratie Un grand marché. Concurrence libre. | Lutte contre les corporatismes. Libre-échangeisme. Lois anti-trust protégeant la concurrence. | Statistiques favorisant la transparence des marchés (cas de l'agriculture américaine). Mesures d'éventuelles positions dominantes. Parts de marché. |
| Etat Providence Le travail salarié et sa protection (depuis la fin du 19 ^e siècle) | Le marché du travail n'est pas un marché comme un autre. Il doit être protégé. | Lois sur la durée du travail, sur les accidents, le chômage, les retraites. Systèmes d'assurances obligatoires garantissant des droits sociaux. | Statistiques du travail. Salaires, chômage. Enquêtes sur les budgets ouvriers. Indices des prix à la consommation. Inégalités sociales selon les PCS. |
| Etat keynésien La demande globale et ses composantes (après les années 1940) | Le marché ne peut pas fonctionner tout seul sans engendrer des crises. Il doit être régulé au niveau global. | Surveillance et pilotage du gap éventuel entre offre et demande globales <i>via</i> les politiques monétaires et budgétaires. | Comptabilité nationale. Analyse de la conjoncture. Cycles. Budgets économiques. Modèles macroéconométriques |
| Etat néo-libéral Polycentrisme, incitations, palmarès (depuis les années 1990) | Un grand marché. <i>Concurrence</i> libre et non faussée. Théorie de l'agence. Financiarisation. Court-termisme. Norme comptable de la <i>Fair Value</i> Démultiplication des centres publics de décision en quasi-entreprises. Société du risque individualisé. Notion de <i>capital humain</i> <i>Mais aussi</i> : débats sur le développement durable, et critiques de la quantification du PIB et de la croissance. | <i>New public management.</i> Evaluation des politiques publiques. La comptabilité publique se rapproche de la comptabilité d'entreprise (LOLF) Passage des droits aux <i>incitations</i> . Bonus-malus. Marché du carbone. Moralisation des individus. <i>Workfare.</i> <i>Empowerment</i> plutôt qu'assistance. Transformation des administrations en <i>agences</i> . Contractualisation. Coordination par émulation : l'oxymore de la « coopétition ». Partenariat public-privé <i>Gouvernance. Accountability. Audit.</i> | Construction d'espaces d'équivalence nouveaux, pour quantifier l'action publique. Objectivation des <i>qualités contractuelles</i> des statistiques. La rapidité est la plus importante. Problème des « révisions ». Quantification du <i>bien-être</i> et de ses facteurs, par des enquêtes d'opinion. Développement des statistiques <i>locales</i> . Construction et usage d' <i>indicateurs</i> pour évaluer et classer des performances. Le <i>benchmarking</i> européen complète ou remplace directives et règlements (MOC). Fichiers de <i>micro-données</i> . Panels d'individus. Microéconométrie. <i>Evidence based policy.</i> Essais randomisés. |