

NOUVELLES RÉFLEXIONS SUR LA MESURE DU PROGRÈS SOCIAL ET DU BIEN-ÊTRE*

Jean-Paul Fitoussi

OFCE, Observatoire français des conjonctures économiques et Université Luiss

Joseph E. Stiglitz

Columbia University

Dans la foulée du Rapport Stiglitz-Sen-Fitoussi, nous proposons ici de nouvelles réflexions sur le progrès social et le bien-être, qui annoncent de nouveaux travaux et de nouvelles avancées. À partir de quelques exemples simples empruntés à l'actualité, nous montrons d'abord comment notre système statistique actuel, du fait à la fois des lacunes des indicateurs existants et de l'absence d'alternatives crédibles, peut implicitement conduire à des conclusions de politique publique entachées d'erreur. Ceci importe au plus haut point car ce que nous mesurons affecte ce que nous faisons. Réduire le bien-être en vue d'augmenter quelque imparfaite mesure de la richesse matérielle que ce soit donne lieu à des politiques totalement erronées. Nous portons ensuite notre attention, selon cette même perspective critique des indicateurs et instruments de mesure actuels, sur des questions essentielles du débat économique contemporain telles que l'effet sur le chômage de la flexibilité des marchés du travail ou encore l'impact sur la croissance du degré d'ouverture financière des économies. Notre évaluation des mesures existantes de bien-être nous laisse convaincus à cet égard que, trop souvent, elles ont conduit les pays à s'orienter dans de mauvaises directions, ou à tout le moins à adopter des politiques dont les bénéfices sont très discutables. Nous montrons en somme qu'il existe des possibilités considérables d'améliorer les indicateurs de bien-être et d'en développer de nouveaux pour mieux servir les buts collectifs des sociétés humaines.

Mots-clés : Rapport Stiglitz-Sen-Fitoussi, progrès social, mesure, bien-être, soutenabilité.

* Communication présentée au 16^e Congrès de l'Association internationale d'économie, Pékin, 4-8 juillet 2011.

Il ne se passe pas une année sans que nos systèmes de mesure ne soient remis en question.

La crise « financière » a révélé que nous (surtout les États-Unis) ne nous ne portions pas aussi bien que nous le pensions sur la base des indicateurs disponibles. Autrement dit, nous avons réalisé que notre croissance économique n'était en réalité pas soutenable, les mesures de la production ayant été exagérées par des phénomènes de bulles dans l'immobilier et par les profits fictifs réalisés dans le secteur financier. Le fait que dans certains pays (tels que les États-Unis) le PIB soit revenu au niveau d'avant la crise ne rend compte en aucune manière de la perte de bien-être qui a résulté de celle-ci. Avec près d'un Américain sur six exclu de l'emploi à temps plein – le reste étant confronté à l'angoisse de perdre sa maison ou son salaire – et les coupes sombres annoncées dans les dépenses publiques et sociales de base, la perte de bien-être est en réalité considérable. La situation en Espagne est encore pire, avec un taux de chômage supérieur à 20 % en moyenne et presque un jeune sur deux privé d'emploi.

Les événements tragiques survenus au Japon cette année peuvent être considérés comme une métaphore de nos problèmes de mesure. Certains suggèrent que, bien que dans le court terme le PIB japonais décline, dans le long terme, il se relèvera suite aux efforts de reconstruction du pays. La catastrophe nucléaire a non seulement angoissé la population mais elle pourrait bien avoir des effets significatifs sur la santé d'un grand nombre de Japonais. Là aussi, les dépenses nécessaires pour répondre à cette menace pourraient augmenter le PIB, peut-être même assez pour sortir le Japon de sa lancinante langueur économique. Mais nul ne prétendra que le Japon est en meilleur état après la catastrophe de Fukushima. Il faudrait une énorme augmentation du PIB pour compenser la destruction de capital, de tous les types d'actifs, que l'événement a causée, et pour atténuer l'angoisse face à l'avenir que tant de Japonais ressentent. Or nous ne sommes pas bien équipés – nos indicateurs ne sont pas correctement adaptés – pour mesurer la valeur des actifs perdus ou détruits. Et même si nous l'étions,

l'arithmétique de la réparation ne nous en dirait que peu sur la façon dont le bien-être du peuple japonais a évolué. La nature mécanique de nos modèles économiques ne nous dira rien des conséquences immatérielles des pertes irréversibles subies par la population. Dans la foulée de Fukushima, nous avons réalisé que nos mesures d'avant la catastrophe n'étaient pas plus justes. Le PIB japonais était peut-être artificiellement plus élevé du fait de la plus grande efficacité économique résultant de la dépendance au nucléaire (plutôt que l'usage des énergies renouvelables par exemple). La menace, aujourd'hui évidente aux yeux de tous, que représentait le traitement des combustibles usagés pour l'ensemble du pays peut avoir contribué alors à un PIB plus élevé en apparence. De la même manière les cadres comptables sous-évaluaient le risque réel avant la crise financière. Le cas japonais est donc une métaphore, car il souligne clairement les trois lacunes fondamentales de nos indicateurs économiques et sociaux : la mesure du « produit économique », la mesure du bien-être et la mesure de la soutenabilité.

Un autre fait universel bien documenté est l'augmentation des inégalités au sein des nations qui caractérise le dernier quart de siècle au moins. Considérer la croissance du PIB ou même celle du revenu net ne nous dirait rien de l'évolution de ces inégalités, et nous donnerait certainement une fausse impression de l'évolution du bien-être sociétal. Il est à cet égard frappant de constater que dans les pays de l'OCDE l'augmentation des revenus de 80 % de la population a été plus faible que le taux de croissance global de l'économie (qui est, bien entendu, une moyenne) et d'autant plus faible que le décile considéré est bas. Si nous voulons des chiffres qui permettent d'évaluer l'impact de la croissance économique sur la société dans son ensemble, il nous faut à l'évidence savoir ce qui se passe pour la plupart des citoyens. Or le PIB ne nous dit rien à ce sujet.

Un autre exemple nous est donné par la révolution dans le monde arabe, notamment en Tunisie, qui a ouvert une nouvelle ère politique dans cette région du monde. Certains économistes (voir par exemple Barro¹) pensent que la liberté politique est un

1. Robert Barro, « Determinants of Economic Growth: a Cross-Country empirical Study », *NBER Working Paper*, n° 5698, août, 1996.

produit de luxe, qui conduit à un taux inférieur de croissance, en raison de la quête de la redistribution à laquelle elle conduit. Mettant de côté le fait de savoir si ces allégations reposent sur de solides bases théoriques ou empiriques (dans le cas précis de la Tunisie au moins, le manque de démocratie a pu contribuer au développement de la corruption, laquelle a eu un effet débilissant sur la croissance), là aussi, le concept utilisé apparaît trompeur. Le PIB n'est pas une mesure du bien-être. Même s'il pouvait être montré qu'en régressant la croissance du PIB sur certains indices de liberté politique, la limitation de la liberté politique conduisait à des augmentations de PIB – et indépendamment de la fragilité de ces exercices empiriques – la conclusion que les pays seraient bien avisés de reporter dans le temps la démocratisation de leur société qu'ils ne peuvent se permettre de s'offrir n'a aucun sens. Il se pourrait bien que le bien-être augmente davantage du fait de l'expansion des libertés politiques que consécutivement à une hausse du PIB, étant donné la façon dont le PIB est mesuré en pratique. En débattant des effets de la liberté politique sur l'évolution du PIB, nous passons à côté du cœur de la question démocratique : le risque vital pris par les populations pour conquérir leur liberté porte témoignage que celui-ci est une composante fondamentale de leur bien-être.

Voilà quelques exemples simples pris dans l'actualité qui montrent clairement comment notre système statistique actuel, du fait à la fois des lacunes des indicateurs existants et de l'absence d'alternatives crédibles, peut implicitement conduire à des conclusions erronées de politique publique.

Ceci importe au plus haut point car ce que nous mesurons affecte ce que nous faisons. Réduire le bien-être en vue d'augmenter quelque imparfaite mesure de la richesse matérielle que ce soit donne lieu à des politiques totalement erronées.

1. Mesures et politiques

Pour les économistes, ces préoccupations sont particulièrement importantes, car nous nous appuyons souvent sur les statistiques (les analyses économétriques en particulier) pour porter des jugements sur ce que sont de bonnes politiques. Ces jugements ne sont fiables que dans la mesure où les données sur lesquelles ils

s'appuient le sont. Certaines de ces études économétriques ont ainsi suggéré que les marchés financiers ou la libéralisation des marchés de capitaux ont contribué à une croissance économique plus élevée. Il est maintenant clair que les conclusions de ces études ont été viciées parce que (i) les chiffres du PIB dans les poussées de croissance étudiées ont été exagérés par les bulles qui accompagnent souvent les épisodes de libéralisation financière ; (ii) à moins d'un horizon temporel adéquat, les pertes qui suivent les épisodes de crise financière ne seront pas prises en compte et ces pertes peuvent plus que compenser les gains à court terme découlant des bulles auxquelles la libéralisation financière donne souvent lieu ; (iii) les conséquences en termes de répartition de ces politiques ne sont pas prises en compte ; de sorte que même si le PIB augmente, il peut en résulter un bien-être moins élevé pour la plupart des citoyens et (iv) les coûts pour le bien-être résultant par exemple de l'insécurité qui suit la volatilité qui accompagne habituellement les mesures de libéralisation ne sont pas pris en compte. Les études empiriques qui ont été menées pour démontrer l'effet bénéfique de la libéralisation des marchés financiers sur la croissance et l'emploi sont sujettes au même genre de problèmes. Il y a donc un hiatus entre certaines des recommandations de politique publique que l'on entend généralement en la matière et la fragilité des éléments empiriques censés les soutenir.

Pour prendre un autre exemple, on a vu dans les années récentes une multitude d'études économétriques visant à montrer de quelle manière certaines institutions du marché du travail, à travers les effets néfastes qu'elles ont sur la flexibilité de l'emploi, affectent négativement le chômage et la croissance. Les études qui portent sur l'impact supposé néfaste de certaines institutions sont, au mieux, en mesure d'expliquer des effets de second ordre. Deux études² portant sur un échantillon de 19 pays de l'OCDE ont abouti de manière indépendante à la même conclusion : le capitalisme est manifestement suffisamment robuste pour accueillir des cadres institutionnels fort différents³.

2. Voir Jean-Paul Fitoussi et Olivier Passet, « Réduction du chômage : les réussites en Europe », Conseil d'Analyse Économique, n° 23, La Documentation Française, 2000 ; et Richard Freeman, « Single peaked vs diversified capitalism : the relation between economic institutions and outcomes », *NBER Working Paper*, n° 7556, 2000.

Mettons de côté pour le moment l'évaluation de l'affirmation selon laquelle des marchés du travail plus flexibles augmentent le PIB (en réduisant l'écart cumulé entre le PIB réel et potentiel) : quelle est l'utilité de ce constat si le PIB n'est pas, en réalité, la juste mesure du bien-être sociétal ?⁴

À vrai dire, beaucoup de partisans du fondamentalisme de marché – qui voient toute intervention externe, publique ou privée, comme une menace pour le bien-être – négligent généralement les « défaillances de marché », larges et bien documentées, qui sont particulièrement répandues sur le marché du travail et du capital. Certaines institutions ont précisément été créées pour pallier ces défaillances en matière d'assurance ou de formation. Si, par exemple, nos indicateurs ne tiennent pas compte des avantages en matière de sécurité que confère l'assurance chômage, la réforme qui s'impose n'est pas l'abolition de l'assurance chômage, mais de la métrique imparfaite qui conduit à cette conclusion erronée. Certaines de ces institutions peuvent être considérées comme reflétant un contrat social qui découle d'un processus démocratique. Il y a des gagnants et des perdants à toute réforme structurelle, dès lors une telle réforme a peu de chance d'aboutir à un résultat Pareto-optimal, ou ne serait-ce qu'à un soutien d'une majorité de l'électorat. Mais, et plus important encore, l'évolution vers une plus grande flexibilité du marché du travail pourrait affecter négativement au moins deux des facteurs déterminants du bien-être : la qualité des emplois (la quête d'un emploi décent) et la sécurité économique. En bref, sur la base de preuves empiriques très fragiles touchant à des phénomènes mal mesurés, nous pourrions tirer des

3. Cette conclusion est en contradiction avec la sagesse commune selon laquelle la diversité des structures institutionnelles joue un rôle déterminant dans l'explication tant du chômage que de la croissance. Les institutions comptent : l'expérience scandinave montre que les politiques actives du marché du travail et les institutions correspondantes peuvent permettre aux marchés du travail de mieux fonctionner, au moins dans les périodes où il n'y a pas de carence importante de la demande globale. Notre discussion se concentre ici sur les institutions qui conduiraient à des marchés du travail moins flexibles.

4. En particulier, la recherche issue du modèle dette-déflation Fisher-Greenwald-Stiglitz montre qu'avec des contrats imparfaitement indexés, une plus grande flexibilité des salaires et des prix peut être associée à des ralentissements économiques plus prononcés et des reprises moins assurées. Ainsi une étude en coupe de la volatilité a montré que la rigidité des salaires et des prix comptait bien moins que les facteurs liés aux marchés financiers (voir Easterly *et al.*, 2001a, 2001b et 2003). Une sécurité plus faible dans l'emploi réduira la volonté des travailleurs d'investir dans le capital spécifique à l'entreprise, et peut donc compromettre la croissance et la productivité.

recommandations politiques dont la mise en œuvre peut réduire le bien-être des sociétés.

Les inférences économétriques se révèlent particulièrement problématiques quand elles sont issues de régressions internationales. Que cela nous plaise ou non, les comparaisons internationales de niveaux et plus encore de taux de croissance jouent en effet désormais un rôle très important dans la conception des politiques publiques. Pour certains, ces régressions nous donnent des bases solides de décision dans la mesure où elles permettent d'isoler les effets de certains facteurs censés nous renseigner sur les différences de performance entre les pays.

Il existe quantité de critiques bien connues de cette méthodologie. Par exemple, le plus souvent, ce type d'exercice consiste à imposer des limites aux coefficients pour qu'ils prennent des valeurs voisines d'un pays à l'autre comme si un modèle unique (à la fois économique et social) était en mesure d'expliquer les résultats économiques et le bien-être partout dans le monde tout à fait indépendamment des choix spécifiques et des arrangements institutionnels mis en œuvre par les différents pays du globe. Si l'équation de ce modèle s'applique bien à un groupe de pays mais pas à un autre, l'estimation de panel conduira néanmoins à des résultats significatifs en raison de l'inclusion du premier groupe. Les conséquences sont évidentes : il serait erroné d'étendre d'éventuelles recommandations à un pays appartenant au second groupe.

Notre préoccupation au sujet de ces exercices économétriques porte ici sur un autre problème. Les comparaisons ne sont significatives que si les procédures et les définitions utilisées pour calculer les comptes nationaux sont comparables et si il n'y a pas de biais dans la construction des séries de données elles-mêmes. Or, il existe encore de « grandes différences dans la façon dont les comptes nationaux sont construits, même parmi les pays européens, a fortiori entre l'Europe et les États-Unis »⁵. Ceci peut avoir de lourdes conséquences. Il n'y a aucun sens, par exemple, à adopter des réformes structurelles destinées à importer les « meilleures pratiques » du pays qui présente la meilleure performance en

5. Joachen Hartwig, « On Misusing National Account Data for Governance Purposes », *Working paper 05-101*, KOF Swiss Economic Institute, ETH, Zurich, 2005.

termes de taux de croissance si le taux de croissance des deux pays diffère principalement en raison des différences dans les manières dont leurs comptes nationaux sont respectivement calculés

Un autre exemple qui reflète des lacunes dans la mesure du PIB reconnues depuis longtemps touche à l'analyse de l'effet de la taille du gouvernement sur la croissance. Parce que la production du secteur public est généralement mesurée par ses *inputs*, on fait l'hypothèse implicite de non-croissance de la productivité du secteur public, alors qu'en fait, dans certains cas (lorsque des études détaillées ont été réalisées) on observe une croissance rapide de la productivité. Inévitablement, cette hypothèse biaise les régressions inter-pays et conduit à l'idée que plus le secteur public est important, moins la croissance de la productivité est forte. Cette assertion ne résulte aucunement d'une compréhension empirique profonde : il s'agit simplement de la conséquence d'un artefact statistique. Considérons, par exemple, ce qui pourrait advenir si l'on décidait de privatiser la Social Security américaine (le système public de retraites). Nous savons que les coûts de transactions associés à ce système sont d'un ordre de grandeur plus faible que pour les programmes privés. Ce programme public est en fait d'une extraordinaire efficacité, et les enquêtes ont montré qu'il est aussi très réactif aux demandes des usagers. Sa privatisation aboutirait à des profits plus élevés pour le secteur des services financiers et des prestations plus faibles pour les retraités américains. Les profits plus élevés se traduiraient probablement par une augmentation du PIB. Mais le bien-être des Américains en serait diminué, et les gains de l'industrie financière s'opèreraient au détriment des retraités. Le bien-être, défini de façon appropriée, déclinerait. Mais il est facile de voir comment les exercices aveugles de régressions inter-pays qui sont devenus à la mode concluraient qu'une telle privatisation serait bonne pour la « croissance ».

2. Usage et abus du concept de soutenabilité

Nous pouvons surmonter ces problèmes importants liés à la mesure du bien-être. La Commission sur la Mesure de la Performance Économique et du Progrès Social a identifié un certain nombre de réformes nécessaires dans cette optique⁶. Certaines pourraient mener à une meilleure mesure du PIB – de sorte que

même si le PIB n'est pas une mesure du bien-être, il soit une meilleure mesure de ce qu'il tente de mesurer. En effet, les besoins de nos systèmes statistiques sont multiples, et une métrique qui est adaptée à un but donné peut être mal adaptée à un autre. On ajoute à la confusion quand une mesure adaptée à un objectif statistique précis est utilisée pour mettre en évidence un autre phénomène économique. Par exemple, le PIB n'est ni une mesure du revenu, ni une mesure du bien-être. Ce que nous voulons mesurer est donc la question clé. On peut vouloir mesurer avec le PIB, par exemple, les niveaux d'activité des marchés, un des objectifs initiaux de la mesure du revenu national.

Mais de plus en plus se fait sentir une demande d'aller au-delà des mesures de l'activité des marchés vers de véritables mesures du bien-être. Et même avant la crise, on s'inquiétait de la question de la soutenabilité et du fait que nos mesures ne nous disaient rien quant à cet enjeu.

C'est pourquoi certains réclament non pas d'améliorer la mesure du PIB, mais de mettre davantage l'accent sur d'autres indicateurs. Considérer le revenu (réel) de l'individu médian et non le PIB par habitant nous donnerait ainsi une meilleure image de ce qui arrive à l'individu typique dans une société. Avant la crise, beaucoup pensaient que les États-Unis avaient eu de bons résultats économiques. Mais s'ils avaient prêté attention au revenu médian, ils auraient vu que les revenus étaient stagnants ou en déclin – et ces mesures ne prennent même pas en compte la plus grande insécurité sociale liée à la réduction de la couverture de l'assurance maladie et des retraites qui ont résulté des réformes régressives des prestations sociales dans les dernières décennies.

Si nous tournons à présent le regard vers l'avenir, notre préoccupation est que le niveau de vie dont nous jouissons aujourd'hui soit au moins celui des générations futures. Nos systèmes statistiques devraient nous dire si oui ou non ce que nous faisons est soutenable, économiquement, écologiquement, politiquement ou socialement. Il y a toute raison de croire que, au moins dans certaines dimensions, ce que nous faisons n'est pas soutenable, mais les statistiques actuelles ne reflètent pas ce fait, exactement

6. Joseph E. Stiglitz, Amartya Sen and Jean Paul Fitoussi, *Mis-measuring our lives, Why GDP does not add up*, The New Press 2010.

comme elles ont donné peu d'indications sur le caractère insoutenable de la croissance économique américaine dans les années précédant la crise.

Et pourtant il est capital pour toute société de former un jugement, si imparfait soit-il, sur le caractère soutenable de sa consommation ou de son bien-être actuels, si les deux sont acquis au détriment des générations futures. Nous pouvons savoir dans une certaine mesure si la richesse d'une société est croissante ou décroissante (par habitant). Si cette richesse, convenablement mesurée, est en augmentation, on peut présumer que la société pourra faire à l'avenir ce qu'elle fait aujourd'hui, c'est-à-dire qu'elle pourra maintenir son revenu par habitant. Mais nous avons besoin d'une mesure globale de la richesse, et nous devons être sûrs que les valorisations qu'elle implique sont correctes. Une telle mesure complète comprend évidemment des mesures de capital physique, de capital humain et social et de capital naturel. Des changements dans ce stock de capital découlent de l'investissement en usines et matériel, dans l'éducation et les institutions, et de l'épuisement des ressources naturelles, de la dépréciation du capital physique et de la dégradation de l'environnement.

Parce que nous savons par exemple que ces prix ne reflètent pas les véritables coûts sociaux liés aux émissions de carbone et l'effet potentiel d'un changement majeur du prix du carbone sur celui de tous les autres actifs, nous sommes réticents à utiliser les prix du marché pour évaluer la soutenabilité environnementale, suggérant plutôt l'utilisation simultanée de mesures physiques de l'état des écosystèmes terrestres.

Mais ce concept de soutenabilité a été utilisé de façon abusive dans la foulée de la crise financière. L'absence d'un indicateur de soutenabilité peut certainement nous conduire à un développement insoutenable, mais une mesure partielle peut nous conduire aussi sûrement à des politiques erronées qui finiraient par mettre en péril la pérennité d'une économie. Prenons l'exemple de l'Europe. Partageant une monnaie commune dans une crise mondiale, les pays de la zone euro sont actuellement à la recherche d'indicateurs de soutenabilité afin d'évaluer leur viabilité financière – par laquelle ils signifient essentiellement la viabilité de la dette publique de chaque pays membre. Ces pays tentent donc de définir des objectifs de soutenabilité, de mettre en œuvre des poli-

tiques économiques favorables à celle-ci et de diffuser ces informations aux marchés financiers afin de réduire la pression sur les emprunts des secteurs public et privé. Le problème est que les pays européens fondent leur démarche sur une vision très partielle de la soutenabilité, à savoir celle de la dette publique, qui les conduit à imposer aux pays périphériques de la zone euro des programmes d'austérité, c'est-à-dire dans les faits des politiques macroéconomiques pro-cycliques, qui vont très certainement conduire à un taux beaucoup plus faible de la croissance économique et peuvent éventuellement aboutir à la non-soutenabilité financière tant du secteur public que privé. Autrement dit, quelle que soit la mesure de soutenabilité que nous concevons, nous devons reconnaître qu'elle sera fondée sur notre imparfaite connaissance présente de l'avenir.

Inévitablement, les mesures sont partiellement issues de modèles : de nombreux indicateurs sur lesquels nous concentrons notre attention ne constituent pas une fin en soi, mais des variables intermédiaires d'intérêt parce qu'ils permettent de mieux comprendre les choses dont nous nous soucions vraiment. La relation entre ces variables intermédiaires et les choses dont nous nous soucions vraiment sont souvent incertaines et dépendent du modèle que nous utilisons. Mais il y a beaucoup d'incertitude au sujet du « bon » modèle. Par exemple, avant la crise, beaucoup ont cru que tous les pays devaient, pour maintenir une croissance élevée et stable, avoir une inflation faible et stable. Dans la foulée de la crise, il y a désormais un large consensus pour dire que l'inflation faible et stable n'était certainement pas une condition suffisante de la stabilité économique. C'est parce que les conclusions qui prévalaient alors étaient elles-mêmes fondées sur des modèles erronés. Et ces modèles encourageaient les économistes à se concentrer sur une variable unique, l'inflation, comme indicateur des perspectives d'avenir du pays. Nous savons maintenant qu'il aurait fallu mettre davantage l'accent sur les indicateurs de stabilité financière.

De même, ceux qui soutiennent à présent un autre critère de viabilité économique, le ratio dette/PIB, en affirmant que celui-ci ne doit pas excéder un niveau donné (disons 80 %) faute de quoi l'économie ne sera pas soutenable, fondent cette conclusion sur un modèle. Or, compte tenu du niveau actuel de la richesse (publique

et privée), même des niveaux plus élevés de dette pourraient bien être soutenables, s'il y a assez d'accélération du progrès technologique. La Grèce n'est pas en faillite : elle est menacée de l'être. Le jugement des marchés financiers peut être une intuition rationnelle de ce que sera l'avenir, mais ne peut prétendre être plus que cela, étant donné les chimères sur lesquelles reposent certaines évaluations du prix des actifs. Dans cette optique, il n'est pas indiqué, par exemple, de forcer la main au gouvernement de la Grèce pour qu'il privatise ses actifs publics pour réduire la dette du pays. Une vente au rabais aggraverait en fait le bilan financier de l'État grec.

3. Comment évaluer le bien-être ?

Les membres de notre Commission étaient convaincus que le PIB ne fournit pas une bonne mesure du bien-être, même en mettant de côté la question de savoir si celui-ci était soutenable. Nous avons donc recommandé la construction de mesures larges du bien-être susceptibles de prendre en considération certains des facteurs les plus importants qui affectent le bien-être, exclus de la mesure du PIB, comme la cohésion sociale.

Dans notre rapport, et dans la discussion entourant sa présentation, nous avons ainsi souligné un autre aspect du débat sur la mesure : alors que de mauvaises mesures peuvent fausser les politiques publiques, un dialogue autour de ce dont nous, en tant que société, nous soucions et le fait que ces préoccupations soient adéquatement reflétées dans nos statistiques, pourraient contribuer non seulement à une meilleure compréhension des limites de ces mesures statistiques mais à la formulation de meilleures politiques, plus attentives aux préoccupations et aux valeurs des citoyens.

Nous croyons que ce dialogue est désormais lancé. Dans de nombreux pays, notamment en France, en Allemagne, en Italie et au Royaume-Uni, des mesures ont été prises pour mettre en œuvre certaines des recommandations de notre rapport (voir dans ce numéro l'article de Blanchet). L'exercice empirique le plus complet a été entrepris par l'OCDE, qui a publié en mai 2011 les premiers résultats de son initiative « Better Life ». Cet exercice témoigne de la volonté de l'OCDE de dialoguer avec la société civile en permettant à chacun de construire son propre indice global de qualité de

vie. 11 indicateurs ont été retenus pour les 34 pays de l'OCDE et certains pays émergents, selon les domaines identifiés dans notre rapport. Les citoyens sont invités à calculer leur propre indice en sélectionnant le poids de chacun dans le bien-être grâce à un outil Internet interactif.

Dix déterminants considérés sont objectifs (santé, emploi, éducation, conditions de logement etc.), et un indicateur est subjectif, à savoir la satisfaction à l'égard de la vie, obtenu grâce à des enquêtes. De tels déterminants subjectifs du bien-être sont évidemment importants. Une longue tradition philosophique considère les individus comme les meilleurs juges de leurs propres conditions. Mais ceux-ci sont également soumis à une sorte de problème d'« incohérence temporelle », car ils peuvent évaluer leur situation (ou même un événement particulier) d'une manière différente à différentes périodes du temps. Certaines personnes peuvent répondre à l'instant même où ils élèvent leurs enfants que cette activité est douloureuse, tandis que lorsqu'on leur demande vingt ans après de porter un jugement sur cette époque, ils s'en souviennent comme la plus satisfaisante de leur vie.

La manière d'interpréter et d'utiliser ces différents résultats dans la recherche sur la mesure du bien-être est l'objet de nombreux travaux en cours⁷. Nous espérons que non seulement cette recherche conduira à de meilleures mesures, mais aussi que l'engagement actif avec la société civile se traduira par des politiques qui visent à l'amélioration du bien-être sociétal, évalué non pas par la mesure imparfaite du PIB, mais par de nouveaux indicateurs.

4. Bien-être et cycles économiques

Cette nécessaire perspective plus large sur la mesure du bien-être est non seulement pertinente pour évaluer les progrès à long terme des sociétés, mais aussi pour comprendre les fluctuations cycliques, telles que celles que beaucoup de pays du monde connaissent au moment où nous écrivons ces lignes. Ironiquement, c'est précisément afin de comprendre les fluctuations

7. Pour des études plus anciennes, voir par exemple Sunstein, C. R., Kahneman, D., Schkade, D., & Ritov, I., « Predictably incoherent judgments », *Stanford Law Review*, 54, 1153-1215, 2002 ; et Kahneman, D., & Krueger, A.B., « Developments in the measurement of subjective well-being », *Journal of Economic Perspectives*, 20, 3-24. 2006.

cycliques que le PIB a été initialement développé. Nous avons noté qu'avant la crise la valeur du PIB a été exagérée. Mais on peut tout autant affirmer que pendant la crise, la perte de bien-être peut être sous-estimée. Le rapport initial de notre Commission a souligné l'importance de l'emploi à ce sujet. C'est un point d'accord parmi les partisans de diverses mesures subjectives du bien-être : le chômage a un effet très néfaste sur la qualité de vie des gens. Les individus qui deviennent chômeurs rendent compte d'une plus faible qualité de vie, même en tenant compte de leur plus faible revenu. Et les effets indésirables du chômage persistent au fil du temps. Les chômeurs signalent également une prévalence plus élevée des différents niveaux d'affects négatifs (tristesse, stress et douleur) et la baisse des pensées positives (joie). On peut aussi soupçonner que les effets néfastes du chômage sont ressentis même par ceux qui ne sont pas chômeurs, en particulier dans les sociétés où le chômage est élevé. Ces mesures subjectives indiquent que les coûts du chômage dépassent la perte de revenu subie par ceux qui perdent leur emploi, reflétant à la fois l'existence d'effets non pécuniaires parmi les chômeurs et d'angoisses générées par le chômage dans le reste de la société.

Aux États-Unis, quelque sept millions de familles ont déjà perdu leur maison depuis le déclenchement de la crise immobilière et des millions d'autres leur emploi. Les deux phénomènes contribuent à des niveaux accrus d'anxiété, même parmi ceux qui sont encore employés et propriétaires de leur logement. La propriété d'un logement affecte le sentiment d'appartenance sociale des individus et leur participation à la vie de la communauté, par exemple dans les écoles de leur quartier – et peut-être donc le bien-être futur de leurs enfants. Nous disposons également d'éléments empiriques sur le lien entre expulsion du logement et santé des individus⁸.

Tout cela suggère que les fluctuations économiques peuvent avoir des effets asymétriques sur le bien-être – quelque chose que nous devrions intuitivement savoir. Par ailleurs, certaines des conséquences adverses (par exemple sur la santé et l'éducation) peuvent être irréversibles. L'utilisation répandue du PIB comme indicateur de résultats intermédiaires ne nous permet pas de

8. Voir par exemple Janet Currie et Erdal Tekin, « Health Consequences of the Foreclosure Crisis » avril 2011.

prendre explicitement en compte ces effets néfastes, non seulement sur le niveau actuel de bien-être, mais aussi sur le *stock* de capital humain. L'économie des cycles d'affaires devrait être repensée à la lumière des divergences probables entre la fluctuation de la production et celle du bien-être. Il se pourrait bien que la tâche des gouvernements soit de concevoir des politiques visant à minimiser davantage le taux de chômage et sa variation au cours du cycle économique plutôt que des politiques visant à maximiser la croissance de sortie (telle que mesurée par le PIB). Certains des instruments de ces deux stratégies peuvent être les mêmes – les préoccupations de l'emploi sont au cœur de la stratégie macroéconomique globale – mais la première stratégie doit assurément reposer sur des instruments spécifiques complémentaires pour lisser l'évolution du chômage. Les risques eux-mêmes peuvent être très asymétriques : une longue période de chômage élevé peut avoir des conséquences beaucoup plus élevées à long terme que celles qui pourraient résulter d'une économie en surchauffe. Par ailleurs, à la lumière des arguments qui précèdent, une telle stratégie améliorera certainement le bien-être, même si elle peut avoir quelques effets négatifs sur la croissance mesurée par le PIB⁹. La conception d'une bonne politique ne peut pas être fondée sur la séparation artificielle entre les politiques sociales et les politiques macro-économiques : si le bien-être des populations est la fin ultime, l'étude du marché du travail et de la répartition des revenus doit être un élément central de l'analyse macroéconomique soutenant les politiques de stabilisation.

5. Au-delà du PIB : l'expérience du Bhoutan

Il nous faut inclure dans nos développements un autre exemple actuel, celui du Bhoutan, dont la quête d'une meilleure mesure du bien-être a commencé bien avant le travail de notre Commission. Quelque quarante ans plus tôt, le roi d'alors décida que l'objectif collectif de cette nation ne serait pas de maximiser le PIB, mais le BNB, le Bonheur National Brut. Plutôt que de se tourner vers une

9. Il convient de souligner, toutefois, qu'il y a quelques raisons de croire que davantage d'accent mis sur la sécurité de l'emploi pourrait également améliorer non seulement le bien-être actuel, mais même la croissance, par exemple en facilitant des investissements plus importants dans le capital humain et une plus grande volonté de prendre des risques.

agence de développement économique et de planification pour la formulation de stratégies de développement, le pays a établi une Commission du Bonheur National Brut. Il ne s'agissait pas de se payer de mots. Des questions ont alors été soulevées qui ne le sont généralement pas lorsque le seul but est d'augmenter le PIB : (a) Quel est l'impact de notre activité économique sur l'environnement ? (la couverture forestière a été développée, même si la coupe des forêts pouvait conduire, dans le court terme, à l'augmentation du PIB). (a) Quid du « capital social » (la cohésion sociale) ? Cet effet n'est pratiquement jamais pris en compte dans le calcul du PIB. Or la confiance dans le gouvernement peut permettre une meilleure conformité aux réglementations environnementales (sans lequel des restrictions sur la coupe des forêts serait très difficile à appliquer) ou plus de réactivité aux efforts du gouvernement pour améliorer l'éducation et la santé des enfants – des actions qui conduiront presque certainement à améliorer le PIB à l'avenir mais dont les avantages n'apparaissent pas dans le PIB d'aujourd'hui.

De ces débats dont on ne rend ici compte que très partiellement ont émergé une approche plus holistique du développement, qui considère celui-ci comme une transformation de la société, qui peut bénéficier des progrès liés à la modernisation (par exemple une plus grande alphabétisation, une plus grande participation politique, une meilleure santé), tout en conservant ses valeurs traditionnelles et son sentiment d'identité et de cohésion. Le développement est ainsi considéré comme plus que la simple accumulation de plusieurs facteurs de production ou une augmentation statique de la productivité. De nouvelles questions sont posées, et de nouvelles approches en découlent : comment favoriser par exemple l'apprentissage entrepreneurial et sociétal ? L'ouverture des chantiers de construction pour une nouvelle école à tous les entrepreneurs, étrangers ou nationaux, pourrait conduire à une réduction des coûts dans le court terme – une apparente meilleure performance économique aujourd'hui. Mais encourager des constructeurs locaux à utiliser des matériaux locaux et des techniques et plans qui s'accordent aux préférences et aux valeurs locales et qui pourraient présenter un intérêt pour d'autres activités de construction peut engendrer beaucoup plus de bénéfices à long terme.

Le Bhoutan est résolument engagé dans un processus de transformation sociétale, et donc, pour ce pays, il était impératif de réfléchir profondément aux directions dans lesquelles la société se transforme. Mais c'est l'ensemble de nos sociétés qui évoluent, même si cette évolution peut paraître lente. S'ils sont bien conçus, nos indicateurs peuvent nous donner de précieux renseignements sur le point où nous sommes, et, au fil du temps, nous fournir une image de l'endroit où nous allons. Ils peuvent nous donner des informations nous permettant d'évaluer si nous atteignons ou pas nos objectifs collectifs et, même si nous réussissons à les atteindre, si nous devons ou pas nous en donner de nouveaux, pour relever de nouveaux défis.

Notre évaluation des mesures existantes de bien-être nous laisse convaincus que, trop souvent, elles ont conduit les pays à s'orienter dans de mauvaises directions, ou à tout le moins à adopter des politiques dont les bénéfiques sont très discutables. Notre quête de meilleures mesures nous a également convaincus qu'il existe aujourd'hui des instruments disponibles qui pourraient mieux nous guider. Nos recherches montrent en somme qu'il existe des possibilités considérables d'améliorer les indicateurs de bien-être et d'en développer de nouveaux pour mieux servir les buts collectifs des sociétés humaines.

Références bibliographiques

- Easterly W., R. Islam, et J.E. Stiglitz, 2001a, « Shaken and Stirred: Explaining Growth Volatility », *Annual Bank Conference on Development Economics 2000*, Washington: World Bank, pp. 191-212.
- , — et —, 2001b, « Shaken and Stirred: Volatility and Macroeconomic Paradigms for Rich and Poor Countries », *Advances in Macroeconomic Theory*, Jacques Drèze, ed., IEA Conference, Volume 133, Houndsmill: Palgrave, 2001, pp. 353-372.
- , — et —, 2003, « Volatility and Macroeconomic Paradigms for Rich and Poor Countries », in Jacques H. Drèze, ed., *Advances in Macroeconomic Theory*, Volume 1, Palgrave MacMillian, pp. 352-372.
- Fitoussi, J.-P., A. Sen et J.E. Stiglitz, 2009, *Mismeasuring Our Lives: Why GDP Doesn't Add Up*, New York: The New Press. (Original report, 2009 ; New Press edition, 2010) Also available at <http://www.stiglitz-sen-fitoussi.fr/en/index.htm> (accessed May 16, 2011).

Kahneman D., A. B. Krueger, D. Schkade, N. Schwarz, et A. Stone, 2002 : « Toward National Well-Being Accounts », *American Economic Review*, mai, pp. 429-434.

Kahneman D., A. B. Krueger, 2006 : « Developments in the Measurement of Subjective Well-Being », *Journal of Economic Perspectives*, Volume 20, n° 1, pp. 3-24.