Expertise sur la pertinence du „rapport Boskin" pour l'indice suisse des prix à la consommation

Prof. H.W. Brachinger - Prof. B. Schips - Prof. W. Stier

Résumé

A. Mandat

En décembre 1996, aux Etats Unis, le rapport final de la „commission Boskin" (‚Advisory Commission to Study the Consumer Price Index') a été publié à l'intention du Sénat américain. La tâche principale de la communauté de travail „rapport Boskin" (ARGE-B) consistait à examiner dans quelle mesure les résultats de ce rapport („rapport Boskin") pouvaient également s'appliquer à la mesure statistique des variations de prix en Suisse. Il s'agissait ensuite de déterminer si les recommandations émises par la commission Boskin à l'intention du „Bureau of Labor Statistics" (BLS) pouvaient également servir de lignes directrices à l'Office fédéral de la statistique (OFS). La communauté de travail avait par ailleurs à définir lesquelles des mesures appliquées par le BLS pour améliorer l'indice des prix à la consommation américain (CPI), mais ne figurant pas dans le rapport Boskin, revêtaient également une certaine importance pour la statistique des prix en Suisse. Elle s'est penchée en outre sur les priorités à fixer pour la révision de l'indice suisse des prix à la consommation de l'an 2000 („IPC 2000"). Il s'agissait enfin de déterminer quelles questions spécifiques inhérentes à la statistique des prix devaient encore être élucidées dans d'autres projets de recherche.

B. Applicabilité des résultats du rapport Boskin

Telles sont les conclusions tirées par la communauté de travail ARGE-B sur la base du rapport Boskin et après analyse de la pratique actuelle dans le domaine de l'indice suisse des prix à la consommation (IPC) :

1. La tâche principale de la statistique des prix consiste à mesurer les variations de prix des biens offerts au niveau de l'économie nationale. Dans un marché de consommation aussi développé que celui de la Suisse, l'offre comprend une multitude de biens. De nouveaux produits s'y ajoutent en permanence et la qualité des biens ne cesse de changer. Il est ainsi particulièrement difficile de mesurer les variations de prix de manière tout à fait ‚correcte': une tâche que l'Office fédéral de la statistique (OFS) accomplit toutefois dans une large mesure avec l'IPC.

2. De nos jours, le concept d'indice de Laspeyres est utilisé couramment dans le monde entier pour mesurer les variations de prix. Ce concept, qui est aussi à la base de l'IPC, part d'un panier fixe de biens et de services („panier-type") et représente un procédé d'estimation statistique. Le but de ce procédé est d'estimer un paramètre économique particulier. Pour les auteurs du rapport Boskin, il ne fait aucun doute que ce paramètre représente la valeur de ‚l'indice du coût de la vie' („Cost-of-Living-Index"). L'établissement d'un tel indice doit permettre de

déterminer les dépenses minimales que doit supporter un consommateur ou un ménage représentatif durant une certaine période, en admettant que les prix relatifs aient varié, pour garder le même niveau d'utilité qu'à la période de base. Dans le cas d'un indice du coût de la vie, il ne s'agit donc pas de maintenir un panier-type, mais un niveau d'utilité constant.

3. L'indice suisse des prix à la consommation sert à mesurer le renchérissement à diverses fins économiques et politiques. Il relève non seulement les changements inhérents au coût de la vie, mais sert également à d'autres fins, telles que l'indexation de séries économiques, et tient lieu de base de déflation pour les comptes nationaux (CN) ou de base de décision pour la politique économique. L'IPC sert par ailleurs de mesure pour la compensation du renchérissement au niveau salarial ainsi que pour l'adaptation d'autres valeurs nominales telles que les loyers et les rentes. Il représente donc d'une certaine manière un indice destiné à remplir différentes fonctions simultanément.

   Il convient par conséquent de se pencher de manière critique sur l'IPC dans l'optique de ces diverses fonctions. La qualité de l'IPC devra être évaluée de manière différente selon l'objectif poursuivi. Pour savoir dans quelle mesure les résultats du rapport Boskin peuvent s'appliquer à l'IPC, on se limitera par conséquent à un objectif partiel de l'IPC, à savoir celui de mesurer les variations du coût de la vie.

4. Il est connu depuis longtemps que le concept d'indice de Laspeyres fournit au fil du temps des valeurs plus ou moins „biaisées" par rapport à l'indice du coût de la vie. A ce propos, la commission Boskin a notamment le mérite d'avoir mis clairement en évidence le fait que ce type d'indice peut comporter différentes sortes de distorsions: le biais de substitution des produits („substitution bias"), celui des canaux de distribution („outlet substitution bias"), le biais de changement de qualité („quality change bias") et le biais de nouveaux produits et services („new product bias").

   Selon l'ARGE-B, d'autres distorsions peuvent encore intervenir dans un indice des prix. Cela peut être le cas lorsque l'on utilise certains paramètres supplémentaires qui vont au-delà de ceux caractérisant le concept d'indice. Dans le cas de l'IPC, les paramètres régionaux jouent, par exemple, un rôle important: les prix sont pondérés selon l'importance démographique de la région de laquelle ils proviennent. Les valeurs de ces paramètres sont toujours soit des grandeurs connues, soit des estimations de ces grandeurs. S'il s'agit de grandeurs connues, le risque de distorsion découle du fait que ces valeurs ont été introduites dans le concept d'indice lors d'une révision de cet indice et ne sont pas actualisées en permanence. Un risque supplémentaire apparaît dans le cas des estimations, celles-ci pouvant être, elles aussi, „biaisées". Selon ces considérations, l'IPC peut également comporter un biais dit régional en plus des distorsions citées plus haut.

5. Il convient, pour l'application pratique du concept d'indice de Laspeyres, d'adopter un système hiérarchique adéquat pour ventiler la multitude des biens à

recenser. La formule de Laspeyres n’est utilisée que pour les catégories de biens classés au niveau des ‚postes de dépenses‘; à ce niveau, des indices sont donc pondérés au moyen de parts de dépenses fixes. En dessous de ce niveau hiérarchique, on calcule également des moyennes arithmétiques pondérées des indices. La pondération reflète l’importance des canaux de distribution et des régions d’où proviennent les prix. Un *biais de substitution des produits* intervient en particulier, lorsque les consommateurs remplacent des biens devenus relativement chers par d’autres produits devenus relativement meilleur marché et que ce phénomène n’est pas suffisamment pris en compte dans la formule de l’indice. On distinguera toutefois le biais de substitution au niveau supérieur („upper level substitution bias"), qui résulte d’un manque de souplesse au niveau des postes de dépenses, du biais de substitution au niveau inférieur („lower level substitution bias"), dû à un manque de flexibilité non pas au niveau des postes de dépenses, mais à celui, inférieur, de l’agrégation de base. On constate un manque de flexibilité au niveau des postes de dépenses avant tout lorsque les parts de dépenses utilisées ne sont pas adaptées aux parts effectives. En dessous du niveau des postes de dépenses, le manque de souplesse apparaît dans le cas où la méthode utilisée lors de ‚l’agrégation de base‘ ne tient compte que de manière insuffisante des rapports de substitution et que les paramètres utilisés ne donnent pas une image actuelle de l’importance des régions et des canaux de distribution.

6. Lors de l’utilisation du concept d’indice de Laspeyres, plus il est rare que le panier-type initial soit actualisé et donc que l’indice soit établi sur une nouvelle base, plus le *biais de substitution des produits au niveau supérieur* est important. Depuis les années 50, le CPI américain a été établi sur une nouvelle base en moyenne tous les 11,25 ans, l’IPC suisse tous les 10 ans. S’il s’écoule moins de temps entre deux révisions et donc entre deux adaptations au niveau des postes de dépenses en Suisse qu’aux Etats-Unis, la différence n’est toutefois que minime. En revanche, les pondérations sont nettement plus actuelles en Suisse qu’aux Etats-Unis, au moment où elles sont introduites pour la première fois dans le calcul de l’indice. Elles datent généralement d’un à deux ans en Suisse, alors qu’elles ont déjà, à ce moment, entre 3 et 5 ans aux Etats-Unis. On peut donc partir du principe que le biais de substitution des produits intervenant au niveau supérieur ne sera pas plus important pour l’IPC suisse que pour le CPI américain. Il ne devrait pas dépasser 0,15 point de %. Ce biais ne peut être réduit que par une mise à jour plus fréquente des pondérations sur la base des dépenses de consommation des ménages les plus actuelles possible.

7. De l’avis de l’ARGE-B, les nouveaux biens peuvent être classés en deux catégories, selon qu’ils sont ou non attribuables en tant que nouvelles variétés à des postes de dépenses existants : les biens „intégrables", pouvant entrer dans le panier-type sans créer de nouveaux postes de dépenses et les biens „non-intégrables", pour lesquels de nouveaux postes de dépenses doivent être formés. En entretenant des contacts réguliers avec les points d’observation des prix et en procédant à sa propre observation du marché, l’OFS s’efforce de déceler à temps les nouveaux biens „intégrables". Les postes de dépenses de l’IPC sont créés de sorte que la plupart des nouveaux produits apparaissant sur le marché et des

nouvelles variantes de biens déjà connus puissent être attribués à des postes existants. Le concept d'agrégation de base développé par l'OFS offre, en outre, le cadre méthodologique nécessaire pour intégrer régulièrement dans le calcul de l'indice les nouveaux produits et les nouvelles variantes de produits existants. La formule d'indice récursive utilisée permet ainsi d'actualiser en permanence l'ensemble des biens. Les changements survenant sur le marché des biens de consommation "intégrables" sont donc largement pris en compte dans l'IPC.

Il ressort des analyses de l'ARGE-B qu'en règle générale, les nouveaux biens et les nouvelles variantes de produits sujets à des changements de qualité sont rapidement pris en compte dans le calcul de l'IPC par rapport aux indices des prix d'autres pays. L'apparition sur le marché de nouveaux produits „non intégrables" est toutefois problématique, étant donné qu'elle requiert la création de nouveaux postes de dépenses. De tels produits ne peuvent donc être pris en considération dans l'IPC que lors de ses révisions périodiques. La distorsion qui en résulte apparaît toutefois rarement; elle est contenue dans le biais de substitution des produits au niveau supérieur. Dans l'ensemble, le *biais de nouveaux produits et services* ainsi que celui *de changement de qualité* ne devraient pas être trop importants dans l'IPC par rapport aux autres pays; ils ne devraient en aucun cas s'élever à plus de 0,2 point de %.

8. Pour l'IPC, on utilise en général actuellement une variante pondérée de *la méthode des indices élémentaires* (méthode de la moyenne arithmétique des rapports de prix) pour l'agrégation de base. Cette méthode s'avère judicieuse pour les postes de dépenses dont les biens ne sont quasiment pas substituables. On peut, en revanche, raisonnablement supposer qu'il existe en général au moins un faible rapport de substitution entre les biens d'un même poste de dépenses. Dans ce cas, l'application de la méthode des indices élémentaires donne lieu à un *biais positif de substitution des produits au niveau inférieur*.

9. La Suisse étant relativement petite, il est plutôt rare d'y voir apparaître de nouveaux canaux de distribution. Le marché des magasins-discount y occupe une place nettement moins importante que dans les autres pays. Ainsi, *le biais des canaux de distribution*, qui intervient lorsque les nouveaux canaux de distribution ne sont pas suffisamment pris en compte dans le calcul de l'indice, devrait être négligeable dans le cas de l'IPC.

10. Un *biais de formule* intervient au niveau de l'agrégation de base, si la manière dont les prix relevés sont agrégés mène à des sous-indices (des postes de dépenses) dont la formule n'a pas les propriétés attribuées à celle du sous-indice ‚idéal'. La méthode récursive de l'OFS consiste à calculer la valeur actuelle de l'indice à partir de sa valeur lors de la période précédente au moyen d'un facteur de correction. Si l'on considère le biais systématiquement positif qu'induit la méthode des indices élémentaires, il faut également être conscient que ce biais risque d'être cumulatif. Cependant, ce dernier est atténué par la tendance à la sous-estimation propre à ce procédé. C'est pourquoi, comme le démontrent des

modèles de calcul, l'IPC peut contenir dans l'ensemble un faible biais de formule soit négatif soit positif.

11. Dans le cas de l'IPC, on utilise des paramètres régionaux au niveau de l'agrégation de base. C'est en effet avec ces paramètres que les prix sont pondérés selon l'importance démographique de la région dans laquelle ils ont été relevés. Les paramètres régionaux sont sujets à des changements qui, s'ils ne sont pas pris en compte, peuvent donner lieu à un *biais régional*. Selon l'ARGE-B, ce genre de distorsion ne devrait toutefois pas s'avérer conséquent pour l'IPC.

12. L'ARGE-B propose de résumer les notions de biais de formule, de biais régional, de biais de substitution des produits au niveau inférieur et de biais des canaux de distribution en un seul terme: le *biais de l'agrégation de base*. Celui-ci ne devrait pas dépasser 0,3 point de % dans l'ensemble en Suisse.

13. Comme le CPI américain, l'IPC ne constitue en aucun cas un véritable indice du coût de la vie. C'est la raison pour laquelle il tend plutôt à surestimer la variation de ce coût. Cette surestimation ne devrait toutefois pas se chiffrer à plus de 0,5 à 0,6 point de % par année.

14. Signalons en résumé que l'IPC représente un indicateur statistique, qui est utilisé simultanément pour différents besoins d'information. Plus on orientera son développement sur celui d'un indice du coût de la vie et moins l'IPC pourra continuer à remplir d'autres fonctions.

C. Recommandations de la communauté de travail ‚rapport Boskin'

La communauté de travail ‚rapport Boskin' (ARGE-B) avait notamment pour tâches de déterminer si et dans quelle mesure les recommandations émises par la commission Boskin peuvent également représenter des lignes directrices pour l'OFS en vue de la révision de l'IPC prévue en l'an 2000. C'est sur la base de ces recommandations et d'une analyse de la pratique actuelle que l'ARGE-B émet en particulier les propositions suivantes:

1. L'OFS calcule actuellement un seul indice des prix pour ce qui est de la consommation, à savoir l'IPC. Celui-ci sert à diverses fins. Etant donné les besoins croissants d'information, l'OFS devrait toutefois calculer à l'avenir d'autres indices des prix en fonction de ces besoins. L'ARGE-B propose que l'OFS passe dans la mesure du possible à un système modulaire d'indices élargi. On entend ici par système modulaire un système d'indices prenant en compte non seulement des schémas de pondération alternatifs, mais aussi différents paniers-type et concepts de mesure des prix (concepts d'utilisation). L'ARGE-B estime qu'il faudrait, dans un tel système, calculer au moins un indice qui soit davantage axé sur la mesure des variations du coût de la vie général.

2. L'ARGE-B est d'avis que le panier-type d'un indice du coût de la vie ne devrait pas contenir des dépenses de transferts obligatoires telles que les impôts ou les

cotisations sociales. D'une part, le concept d'un tel indice se base sur le libre choix des consommateurs et, d'autre part, les dépenses de transferts obligatoires ne couvrent que les frais des prestations fournies aux consommateurs. Les prix relatifs au transfert du risque dans le cadre des assurances privées, en revanche, ont leur place dans le panier-type d'un indice du coût de la vie.

3. L'OFS devrait utiliser, à court terme, une méthode qui repose sur la moyenne géométrique pour l'agrégation de base. La littérature spécialisée donne largement la préférence à une telle méthode, plus appropriée dans l'ensemble pour mesurer les variations du coût de la vie que la méthode des indices élémentaires utilisée jusqu'à présent.

4. A moyen terme, l'OFS devrait se détourner de l'orientation exclusive du concept théorique de l'indice de Laspeyres. Il s'agit de déterminer dans quelle mesure il est possible de calculer un indice des prix supérieur de type Törnqvist pour mesurer les variations du coût de la vie. Ce type d'indice se caractérise par le fait qu'il concorde avec l'indice du coût de la vie pour une large palette de fonctions d'utilité.

   Un problème important se pose toutefois dans le cas d'un indice des prix de type Törnqvist: celui-ci ne peut être calculé qu'avec un certain retard, même en cas d'enquêtes annuelles sur les revenus et la consommation. On peut toutefois obtenir de bonnes approximations d'un indice-chaîne de type Törnqvist au moyen d'un indice-chaîne de type Laspeyres. Ainsi, pour calculer les indices mensuels, l'OFS devrait renoncer à l'indice des prix conventionnel de type Laspeyres et calculer un indice-chaîne de type Laspeyres.

5. L'OFS devrait se pencher davantage, en collaboration avec un groupe d'experts indépendant, sur l'utilisation des compétences spécialisées et des résultats actuels des recherches. Il s'agit de songer à la réalisation d'autres expertises sur la mesure statistique des variations de prix. Cela reviendrait notamment à déterminer dans quelle mesure les méthodes dites hédoniques sont utilisables pour mesurer les changements de qualité et quels sont les rapports de dépendance entre les distorsions et les taux de renchérissement généraux. Il convient par ailleurs d'analyser de manière ciblée les distorsions de l'IPC pour chacun des principaux groupes de biens et de calculer, du moins tout d'abord à titre expérimental, les indices du coût de la vie de différents groupes socio-économiques. En outre, il faudrait également se pencher sur les avantages et désavantages respectifs d'un indice-chaîne de Laspeyres par rapport à un indice de type Törnqvist, dit „trailing" Törnqvist.

Le rapport détaillé n'est disponible qu'en langue allemande et a été publié dans la série "Statistique de la Suisse". Cette publication peut être commandée auprès de **l'Office fédéral de la statistique, Espace de l'Europe 10, CH-2010 Neuchâtel.**

Commandes: Tel. 032 / 713 60 60, Fax 032 / 713 60 61,
Numéro de commande: 298-9900

Copyright ©2000, Office fédéral de la statistique, Neuchâtel