

L'indice de commandes rénové

Laila BENTOUDJA¹ et Cynthia GABORIEAU-FAIVRE²

L'indice de commandes est produit en France depuis 2003, suite au règlement sur les statistiques de court terme de mars 2001 qui rendait obligatoire la diffusion d'indicateurs permettant de suivre l'évolution de l'activité industrielle à un niveau infra-annuel.

Cet indice devait, entre autres contraintes, être en base 2000. Or le recueil des entrées de commandes cette année-là en France n'a constitué qu'une faible part du champ que devait couvrir l'indice. Pour le reste du champ, une rétropolation des données observées a donc été nécessaire, mais peu d'information auxiliaire était disponible pour ce faire en 2003.

La phase de rétropolation a donc été reprise en 2007 grâce à des méthodes économétriques, pour l'essentiel des modèles de cointégration fondés sur les variables de facturation ou d'exportation des douanes.

De tels modèles présentent l'intérêt de « corriger des erreurs » au sens où les écarts entre commandes et facturations, loin de se cumuler au fil du temps, sont effacés à long terme. Cela permet au rétropoleur de « guider » l'évolution de la série rétropolée en tendance. Puis les séries de commandes brutes rétropolées ont été établies au moyen des tendances estimées sur le passé en appliquant un coefficient saisonnier moyen calculé sur les données réellement observées.

Parallèlement, une interrogation s'était fait jour sur la hausse très importante et jugée anormale de l'indice de commandes relatif aux navires marchands survenue en novembre 2005. En effet celle-ci était d'un tout autre ordre de grandeur que les variations habituellement observées pour cet indice. Il s'est avéré après recherche exhaustive dans la presse que des commandes semblables avaient bien eu lieu par le passé, et que ces « grosses commandes » avaient échappé au dispositif de recueil des données. Elles ont donc été ré-introduites dans les séries ad hoc.

Enfin, des distorsions introduites dans l'indice par le biais des pondérations (constituées en l'occurrence par les ventes de la comptabilité nationale) étaient apparues. En effet, deux commandes de valeurs semblables enregistrées pour des trains d'une part et des navires marchands d'autre part avaient des effets très distincts sur l'évolution de l'indice, les premières étant sous-pondérées par rapport aux secondes.

Ce constat a conduit à l'abandon des pondérations de l'indice par les ventes : l'indice est désormais autopondéré.

¹ Service de la Statistique et de la Prospective, ministère de l'Agriculture - laila.bentoudja@agriculture.gouv.fr

² DSE, Insee - cynthia.favre@insee.fr

Ces trois éléments conjugués ont permis une profonde rénovation de l'indice. Ils ont rendu possible une meilleure homogénéité des séries au fil du temps. Cela a préparé le terrain pour une désaisonnalisation de meilleure qualité. De façon plus générale, l'indice y a gagné en robustesse et en pertinence.