Diagonales : Pouvait-on prévoir la crise ?

14-11-2011

"Les résultats des systèmes d'alerte avancée demeurent jusqu'à présent mitigés. Les prévisions des modèles les plus prometteurs contiennent des informations substantielles sur le risque de crise, mais ils produisent souvent de fausses alertes. Les modèles tendent à se comporter beaucoup mieux sur les périodes historiques pour lesquelles ils ont été conçus et évalués («à l'intérieur de l'échantillon») que pour des périodes ultérieures («au-dehors de l'échantillon»). C'est ainsi que les experts du FMI concluent en 2000 leur étude sur la difficulté de prévoir les crises économiques.

Pierre Dac, formé à l'université de la rue, l'avait deviné depuis longtemps : Les prévisions sont difficiles, surtout lorsqu'elles concernent l'avenir !

Jean-Jacques
Salomon

jjsalomon@oomark.com