

**Université Catholique du Congo**  
**FACULTE D'ECONOMIE ET DEVELOPPEMENT**  
B.P : 1534  
KINSHASA/LIMETE

**DEMOCRATIE ET TAILLE DU GOUVERNEMENT**  
**EN AFRIQUE**

Par

**BIYEVANGA MAYASI Ridi**

Mémoire présenté et défendu en vue de l'obtention du  
Grade de Licencié en Économie et Développement

Option : **Économie Quantitative et Gestion Informatique**  
(EQGI)

Directeur : **Pr. Dr. KASESHI MULENGE Adélard-Diens**

**Octobre 2020**



**DEMOCRATIE ET TAILLE DU GOUVERNEMENT  
EN AFRIQUE**

PAR

**BIYEVANGA MAYASI RIDI**

## EPIGRAPHE

Les Américains, les Européens et les peuples des autres démocraties du monde sont très fiers de leurs institutions démocratiques. Mais les manifestants demandent : est-ce une démocratie réelle ? Une démocratie réelle ne se résume pas au droit de voter tous les deux ou quatre ans. Il faut que les choix aient du sens ; que les élus écoutent la voix des citoyens. Or, de plus en plus, et tout particulièrement aux États-Unis, le système politique paraît préférer le principe « un dollar, une voix » au principe « une personne, une voix ». Loin de corriger les échecs du marché, il les aggrave... »

---

Joseph E. STIGLITZ, 2012 (The Price of Inequality, W.W. Norton, New-York, p.10.)

J'ai la satisfaction de penser que si j'ai commis des fautes dans le courant de cette étude, j'ai du moins, bien certainement réussi dans le choix de ceux à qui je l'adresse. Non seulement je remplis un devoir et je fais preuve de reconnaissance, mais je m'éloigne de l'usage ordinaire aux penseurs qui dédient toujours leurs pensées à quelques auteurs et qui, aveuglés par l'ambition ou par l'avarice, exaltent en eux les vertus qu'ils n'ont pas, au lieu de le reprendre de leurs vices réels. Pour éviter ce défaut, je ne l'adresse pas à ceux qui sont chercheurs, mais à ceux qui, par leurs qualités, seraient dignes de l'être ; non à ceux qui pourraient me combler d'honneurs et de biens, mais plutôt à ceux qui le voudraient sans le pouvoir.

---

BIYEVANGA M. Ridi-Michel

## **DÉDICACE**

À nos sublimes et aimables parents, Monsieur Dick MBIYAVANGA et Madame Mamie KINAMVUIDI, qui ont consacré leur vie à l'idée que nous pouvons briller d'un éclat plus vif que le soleil ;

À nos frères et sœurs les BIYEVANGA'S, avec qui nous avons reçu de nos aimables géniteurs, les études comme héritage de leurs patrimoines. Héritage sans lequel nous manquerions de cherté ;

À mon sympathique ami et petit frère Exaucé NGOMA, Je te dédie ce travail, fruit de ma passion sans relâche à la recherche scientifique dont les externalités positives sont encore latentes ;

À tous les partisans du travail acharné ;

## REMERCIEMENTS

En nous plongeant dans les eaux profondes et silencieuses de la recherche, le Divin, nous a entourés des merveilles innombrables. S'il ne le faisait directement à notre égard, il avait l'art de disposer des personnes particulières pour nous offrir un sourire quand nous en avons besoin, pour nous aider à porter notre croix, tels des Simon de Cyrène ou pour célébrer nos victoires et nous impulser davantage à l'excellence.

Reconnaissons-nous certaines dettes au fil des notes des chapitres qui suivent, mais serons-nous impardonnables de ne pas mentionner le minutieux travail accompli par le Professeur Abbé Adélaré KASESHI tout au long de la direction de ce travail. Ses remarques et commentaires m'ont permis d'améliorer le contenu de la présente étude.

Devons-nous témoigner ab imo pectore notre profonde gratitude à l'égard de Monsieur Jean-Paul K. TSASA, Ph. D Candidate de l'Université de Québec à Montréal, le premier à nous initier sur le chemin de la recherche scientifique que nous voulions et qui nous a réveillés par le son d'un plus raisonnable clairon alors que nous nous endormions dans la mollesse. Ce travail est le fruit du principe qui lui est cher : travail acharné et discipline d'airain.

Nous avons tiré grand profit des débats sur la taille du gouvernement de nos multiples échanges avec Monsieur Michel-Ange LOKOTA ILONDO, Coordonnateur du Laboratoire d'Analyse-Recherche en Économie Quantitative, à qui nous exprimons notre profonde gratitude.

Rajoutons quelques nouvelles "têtes" à notre liste de créditeurs. En particulier, l'honorable Serge MAABE MUANYIMI, l'assistant Hervé NLANDU, Messieurs Juslain DEMBELE, Tychique NSOMI, Jonathan MOMBO et Merveille WAULA qui nous ont fourni une documentation pertinente et dont les multiples interactions ont concouru au raffinement de cette étude.

La pauvreté du verbe fait défaut pour exprimer notre gratitude à nos deux amis aspirants-chercheurs, notamment Christo-didyme MABANGA avec qui nous avons rêvé de copartager le Prix de la Banque Suède en Sciences Économiques en mémoire d'Alfred Nobel, communément désigné Prix Nobel d'économie. Et, Gentil ISHARA, l'un de mes premiers coauteurs dans la recherche scientifique, qui a été d'une importance capitale tout au long de la rédaction de ce travail.

Inutile de dire que l'avertissement d'usage s'applique : toute coquille, erreur, confusion, formulation obscure restante est de ma responsabilité et rien que de la mienne !

## SIGLES ET ABRÉVIATIONS

ADF	: Augmenté de Dickey-Fuller
ANC	: African National Congress
GMM	: Generalized Method of Moments
IDE	: Investissements Directs Étrangers
IDH	: Indice de Développement Humain
IPS	: Im, Pesaran et Shin
LL	: Levin et Lin
LLC	: Levin, Lin et Chu
MCO	: Moindre carré Ordinaire
PIB	: Produit Intérieur Brut
PIBH	: Produit Intérieur Brut par habitant
PNUD	: Programme des Nations Unies pour le développement
PP	: Phillips-Perron

## LISTE DES TABLEAUX

Tableau 2.1 – Variables du modèle.....	48
Tableau 3.1 – Test de stationnarité de Levin, Lin et Chu.....	71
Tableau 3.2 – Test de stationnarité de Im, Pesaran et Shin W-stat.....	72
Tableau 3.3 – Test de stationnarité de type Fisher utilisant le test ADF.....	73
Tableau 3.4 – Test de stationnarité de Phillips-Perron.....	74
Tableau 3.5 – Résultats de la régression avec l'indice de Freedom House.....	76
Tableau 3.6 – Résultats de la régression avec l'indice de Polity IV.....	77



## INTRODUCTION

### 0.1            **État de la question**

La notion de démocratie est apparue dans la réflexion académique d'abord à travers la philosophie politique par divers auteurs. Deux grands penseurs de l'antiquité se sont opposés à ce sujet notamment Platon qui pense que le régime idéal est l'aristocratie où le savoir et la raison dominant. En revanche, Aristote pense que le pouvoir, émanant d'en bas, doit être exercé au nom de tous.

En parallèle, la notion de taille du gouvernement remonte également de réflexions académiques à travers la philosophie politique. Le questionnement de Aristote, notamment : "combien y a-t-il de dirigeants (un, plusieurs, ou le plus grand nombre) ; qui en profite le plus ? À cet égard, la démocratie est mal placée : elle n'est pour Aristote, comme la tyrannie d'un seul ou l'oligarchie de quelques-uns, qu'une forme dégradée du gouvernement constitutionnel ou république" (Holeindre et Benoît, 2010, p.329). Aristote pense que la démocratie ne fonctionne que pour ceux qui la dirigent, c'est-à-dire du Démon, alors que les constitutions droites recherchent le bien de tous. À ce sujet, Platon, dans la "république" était plus précis en avançant que la taille adéquate d'une cité serait de cinq mille quarante individus. Soit dit, en passant, que les deux philosophes réfléchissent dans le contexte des sociétés moins complexes et structurées que les nôtres aujourd'hui.

Ainsi, les travaux fondateurs des théoriciens du contrat social, (Hobbes, 1651 ; Locke, 1690 et Rousseau, 1762), pour ne citer que ces trois, constituent une réponse à la deuxième question de Aristote. Selon ces théoriciens, les membres d'une société ont établi un pacte selon lequel ils ont abandonné la liberté dont ils jouissent dans l'état de nature<sup>1</sup> au profit de l'État qui acquiert ainsi la souveraineté et leur garantit en retour la protection de leurs droits individuels. Cette idée créatrice de la société voire de l'État ne s'appliquait que sur le plan administratif.

En dérivation, si la notion de l'État ou des pouvoirs publics remonte de l'antiquité, la théorisation affinée de l'intervention des pouvoirs publics dans la vie économique est l'œuvre

---

<sup>1</sup> . L'état de nature est l'état des hommes n'ayant entre eux d'autre lien que leur qualité commune d'être des êtres humains, chacun étant libre et égal à tous. L'état de nature est caractérisé par l'absence d'institutions, ce qui conduit, chez Hobbes, à la guerre de tous contre tous, ou de chacun contre chacun.

de Keynes (1936) en réponse à la crise économique de 1929<sup>2</sup>. Contrairement aux classiques, Keynes pense que le marché ne se régule pas spontanément, ce qui justifie l'intervention de l'État dans certaines circonstances. L'État doit ainsi prendre des mesures pour améliorer le climat économique, avec une relance de l'économie. L'intervention publique peut prendre différents canaux, notamment les dépenses publiques<sup>3</sup>. Il convient de signaler qu'il n'existe pas une façon univoque de mesurer la taille absolue ou relative dans l'économie. De façon générale, quelques indicateurs sont le plus souvent utilisés, à savoir : le ratio des dépenses publiques ou des impôts au PIB ou la population résidente ; la part des emplois publics dans le total des emplois dans une économie. Toutefois, aucun de ces indicateurs ne peut être manié sans se référer au contexte institutionnel du pays concerné. D'où, le besoin d'une analyse comparée pour identifier le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement dans quelques pays d'Afrique.

À ce jour, au mieux de notre connaissance, seules quatre études ont procédé systématiquement à l'analyse du binôme démocratie-taille du gouvernement : Funk et Gathmann, 2011 ; Kotera et al. 2012 ; Aidt et Jensen, 2013 ; Qiao et al. 2019).

Les preuves empiriques existantes sur le lien entre démocratie et taille du gouvernement montrent des liens mixtes entre les deux variables. Par exemple, l'étude de Funk et Gathmann (2011) sur vingt-cinq cantons suisses de 1890 à 2000 montre que la démocratie directe par référendum budgétaire obligatoire réduit les dépenses de cantons de 12%. Cependant, la démocratie directe au niveau des cantons ne se traduit pas dans une augmentation des dépenses locales ni dans la décentralisation. Aidt et Jensen (2013) montrent que le vote secret n'a pas d'impact sur les recettes fiscales par habitant mais pourrait induire a augmenté la taille du gouvernement par rapport au PIB en Europe Occidentale entre 1820 et 1913.

Cependant, la démocratie ne se limite pas exclusivement à l'expérience du vote et à la garantie des droits des citoyens. D'autres aspects, tels que la décentralisation, ont également été considérée dans l'étude de la relation entre la démocratie et la taille du gouvernement. Par exemple, Qiao et al. (2019) constatent que la décentralisation fiscale est associée négativement

---

<sup>2</sup> . La grande dépression dite aussi crise économique des années 1930, est la période de l'histoire mondiale qui va du krach de 1929 aux États-Unis. Précédé par la puissante expansion des années 1920, c'est la plus importante dépression économique du 20e siècle, qui s'accompagna d'une importante déflation et d'une explosion du chômage et poussa les autorités à une profonde réforme des marchés financiers.

<sup>3</sup> . L'une de mesures de la taille du gouvernement ou de l'État dans la littérature.

avec la taille du gouvernement dans soixante-seize pays développés et en développement utilisant les données de 2007 à 2013. En outre, un niveau de démocratie plus élevé tend à atténuer l'impact négatif de la décentralisation.

Alors que les documents ci-dessus se concentrent sur l'impact de la démocratie sur la taille du gouvernement, l'étude de Kotera et al. (2012) se concentre sur l'effet de la taille du gouvernement sur la corruption dans quatre-vingt-quatre pays de 1995 à 2008, en prenant compte du rôle de la démocratie. Les auteurs constatent qu'une augmentation des dépenses publiques peut réduire la corruption si le niveau de la démocratie est très faible. Leurs résultats sont robustes à l'utilisation d'un proxy différent pour la taille du gouvernement.

Il convient de mentionner qu'à l'exception de Kotera et al. (2012), les études empiriques ont examiné l'effet de la démocratie sur la taille du gouvernement, en se concentrant soit sur les conséquences de l'extension du droit de vote et de la réforme du vote, soit sur la l'effet de la démocratie directe ou sur l'effet de la décentralisation fiscale. Kotera et al. (2012), en revanche, examinent l'effet de la taille du gouvernement sur la corruption en contrôlant la démocratie.

Ainsi, notre touche particulière consiste à investiguer sur l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie partant du constat que les nouvelles démocraties ont généralement une large taille du gouvernement du fait que le gouvernement pris comme service public a généralement autre vocation que la satisfaction de l'intérêt général.

Ce travail est, ainsi, nivelé sur le souci de scruter l'influence des choix publics (Démocratie) afin de percer leurs effets sur les variables macroéconomiques.

## **0.2                    Problématique**

Le XXe siècle a été particulièrement marqué par la progression de la taille du gouvernement ou de l'État aussi bien dans les pays développés que dans les pays en développement. L'État consomme, dans la plupart des pays, plus de la moitié du revenu national. Quelles ont été les conséquences de cette croissance sur la démocratie ? Mais la démocratie, qu'est-ce ?

Dans le contexte africain, plus d'un demi-siècle après le colonialisme, les régimes démocratiques sont toujours minoritaires sur le continent africain. La plupart des États, n'étant pas nécessairement autoritaires ou répressif, ne favorisent ni les principes de l'État de droit, ni

l'émergence d'une élite politique. Dans ces circonstances, il convient de s'interroger sur la capacité d'arrangements institutionnels pour parvenir à des décisions politiques par lesquelles la population acquiert le pouvoir de décider par le biais de la concurrence démocratique afin de déclencher le développement économique.

En effet, si la démocratie a pour base de réflexion et d'action le peuple, il faut donc reconnaître qu'il y a des moments dans l'histoire où, dans le monde entier, les peuples se lèvent. Ils disent : ça ne va pas ? et exigent que ça change. C'est ce qui s'est passé en 1848 et en 1968, et ces années tumultueuses ont, l'une et l'autre,<sup>4</sup> donné le coup d'envoi d'une ère nouvelle. L'année 2011 a peut-être été un nouveau moment de ce genre. Né en Tunisie, [...] le soulèvement de la jeunesse a gagné l'Égypte, puis d'autres pays du Moyen-Orient. Dans certains, l'étincelle des protestations a paru s'éteindre, du moins pour un temps. Mais dans d'autres, de petites manifestations ont fini par provoquer des changements cataclysmiques, qui ont emporté des dirigeants établis de longue date, comme Hosni Moubarak en Égypte et Mouammar Kadhafi en Libye. [...] les peuples, pour leurs propres raisons, sont descendus dans la rue (Stiglitz, 2012, p.3).

Cependant, les récentes manifestations dans la lignée du Printemps arabe, notamment en Afrique du Nord, ont montré les limites des régimes politiques sur le continent, indiquant que la mise en œuvre d'une véritable démocratie est le meilleur moyen de réduire les inégalités sociales tout en favorisant le développement durable. En fait, la démocratie peut être considérée comme le meilleur moyen vers le développement en ce sens qu'un système démocratique permet la contribution de chacun et le déploiement des capacités créatives (De Saint Moulin et al., 2003).

La démocratie est l'un des concepts les plus utilisés et les plus contestés en sciences sociales. Cette diversité théorique se reflète amplement dans le domaine empirique (Siddhârta et al, 2004). Lipset (1994) renseigne à ce propos qu'au cours des années 1980 et au début des années 1990, dans de nombreux pays, la démocratisation politique s'est produite en même temps qu'une crise économique profonde et qu'atteindre la légitimité est prioritaire aux nouvelles

---

<sup>4</sup> . L'année 1848 désigne la révolution, parfois dénommée « révolution de Février », est la troisième révolution française après la Révolution française de 1789 et celle de 1830. Elle se déroule à Paris du 22 au 25 février 1848. Par ailleurs, l'année 1968 est marquée par une série de révoltes principalement étudiantes un peu partout sur la planète.

démocraties. C'est de l'efficacité, en particulier dans l'arène économique, mais aussi dans la politique. De plus, "dans certains pays en développement, la transition démocratique ne favorise pas la mise en œuvre de réformes économiques substantielles. L'exemple de l'Inde en témoigne" (Sumata, 2014, p.36).

Ainsi, se situant au carrefour de tous les domaines voire de toutes les sciences, la problématique de la démocratie est prééminente à toute autre question car les nouvelles démocraties ont un faible niveau de légitimité, il faut faire preuve d'une grande prudence quant aux perspectives de long terme de ce régime (Lipset, 1994). Néanmoins, (Gonidec, 1997, p.11) estime que "quel que soit le résultat des changements intervenus au cours des dernières années, [...] le problème reste posé : quelle démocratie pour quel développement ? Aucune réponse claire n'a été jusqu'ici apportée à cette question".

La démocratie soutient le développement économique et le développement économique suscite la démocratie. Cet avis de Lipset (1959) établissant une causalité bidirectionnelle entre la démocratie et le développement est aujourd'hui remis en cause par l'émergence du consensus de Pékin qui se veut une alternative au consensus de Washington : l'émergence et le développement économique de pays autoritaires comme les nouveaux pays industrialisés d'Asie ou la République populaire de Chine serait la preuve de la non-validité de cette théorie.

En parallèle, il sied de noter qu'en macroéconomie du développement, l'alternative au Consensus de Washington, c'est le Consensus de Monterrey qui met l'accent sur l'effort à fournir dans plusieurs domaines de développement, en particulier trois : la mobilisation des ressources nationales, l'adoption au plan national de politiques macroéconomiques rationnelles qui tiennent en compte la nécessité d'assurer la viabilité des politiques budgétaires, moyennant une fiscalité et une administration fiscales équitables ainsi qu'un réaménagement des dépenses publiques sans supplanter l'investissement productif privé.

En Afrique, il semble que le processus de démocratisation ait précédé l'instauration des réformes économiques. En règle générale, cette dynamique n'a pas entraîné d'incitations positives ni de croissance économique substantielle. Cependant, il n'en est pas de même pour les pays d'Asie du Sud-Est, en général, et les quatre dragons, en particulier (Singapour, Taiwan, Corée du Sud et Hong-Kong) qui ont pu réaliser des taux de croissance significatifs dans le cadre de régimes politiques non démocratiques et autoritaires. De même, le maintien d'un

régime répressif récemment en Chine n'a pas empêché la réalisation d'une croissance économique soutenue sur un horizon temporel long (Sumata, 2014).

En parallèle, Mcfaul (2002) se questionnait après l'effondrement du mur de Berlin en 1989 et l'effondrement de l'Union soviétique en 1991 pour savoir pourquoi certains États ont-ils abandonné le communisme au profit de la démocratie alors que d'autres se sont tournés vers un régime autoritaire. Les transitions réussies du communisme à la démocratie peuvent ressembler davantage à la norme, tandis que les transitions pactées en Amérique latine et en Europe méridionale peuvent ressembler plus à une aberration. Aussi, les causes de la démocratisation se distinguent d'un pays à un autre.

Il convient de souligner que "la montée de nouveaux régimes économiques et politiques dans l'ancien monde communiste est venue sensibiliser les chercheurs à une série de préoccupations précédemment négligées. Ceux-ci incluent le pacte de transition du régime économique sur le projet démocratique; distinction cruciale entre la mise en place de démocraties véritablement nouvelles (comme dans la plupart des États postcommunistes) par rapport à la redémocratisation (comme dans beaucoup des pays d'Amérique latine et Europe méridionale); l'impact de la politique identitaire et l'état sur la démocratisation; les conséquences pour la démocratie politique des carences de la société civile et politique et le rôle des institutions internationales pour fonder, soutenir et/ou saper les nouvelles démocraties" (Bunce, 2003, p.168).

Ces questionnements ont réorienté le débat sur la démocratie du point de vue performance économique des États non démocratiques et ont poussé les chercheurs notamment Diamond (2003) à s'interroger si la Russie est-elle démocratique. Qu'en est-il de l'Ukraine, du Nigéria, de l'Indonésie, de la Turquie voire du Venezuela. À ces questions, nous restons perplexes de dire haut le meilleur régime qui puisse consolider la santé économique.

Du reste, nous épousons la conclusion de Carnegie (2009, p.525) qui s'argue à propos de l'Indonésie que "l'importance est de nous rappeler que la démocratisation est un processus et rarement, voire jamais un idéal". L'exemple le plus éloquent est celui de la Corée du Sud avec l'administration de Roh Tae WOO qui peut être considérée comme le plus grand succès de l'administration post-autoritaire avec sa politique de Nordpolitik qui a muté le pays vers la démocratisation, mais la récession mondiale des années 1990 a limité tout espoir de réformes

et de programmes économiques et sociaux. Ce fut donc l'échec de la nouvelle transition démocratique (Grazyna, 2010).

De plus, Certains auteurs confirment qu'il existe un lien entre la démocratie ou l'un des éléments composants cette mesure (Droits de propriété, droits politiques, la liberté civile etc.) et les indicateurs socioéconomiques (Barro, 1999), il en est pas de même pour Galenson (1959) et Schweinitz (1959) qui estiment que la démocratie sape la croissance du fait qu'elle libère des pressions pour une consommation immédiate, ce qui se produit au détriment de l'investissement, donc de la croissance. La démocratie serait donc hostile au développement économique et que les dictatures sont donc mieux en mesure de forcer l'épargne et de lancer la croissance économique (Huntington, 1968 ; Huntington et Dominguez, 1975).

Cependant, pour North (1990) les dirigeants autonomes sont prédateurs. L'autonomie des États est pernicieuse à la performance économique du fait que l'État s'attaque à la société civile. Par contre, les institutions démocratiques peuvent le contraindre à agir pour l'intérêt individuel plutôt que général. De ce point de vue, les dictateurs de toutes tendances sont une source d'inefficacité.

Les systèmes démocratiques permettent une coupure nette de la responsabilité des dirigeants en termes des politiques macroéconomiques et de redistribution sociale qui sont à la base de la réélection et l'évaluation par la population, des capacités des dirigeants à travailler pour l'intérêt général. On peut affirmer que la croissance économique et la prospérité, ainsi que l'accumulation de richesses par des activités productives serait utopique sans une et que la réélection démocratique des dirigeants est soumise à des conditions de croissance économique (Alesina et Rosenthal, 1995; Vedder et Gallaway, 1998).

En outre, il est important de noter que les dépenses publiques inefficaces financées par les impôts impactent négativement la croissance économique (Barro, 1996a). Dans le même sens, la démocratie est favorable à l'augmentation de la croissance du revenu par habitant, bien qu'avec un degré modéré de la participation politique (Plümper et Martin, 2003).

Il s'ensuit que la question de la taille du gouvernement est indissociable de la relation entre la démocratie et la croissance, puisque la taille du gouvernement peut être le résultat d'arrangements institutionnels, qu'il s'agisse autocratique ou démocratique.

Les antipodes relevés précédemment ainsi que le constat selon lequel les nouvelles démocraties ont tendance à avoir une large taille du gouvernement pousse à une interrogation : Quel est l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie ? Quel est l'effet du développement sur la démocratie ?

Ces questions sont d'une très grande importance pour tous les pays africains. Les réponses subséquentes doivent cependant être considérées sous la lumière d'une idée qui, actuellement, ne fera pas l'unanimité.

### **0.3 Hypothèses**

Les questions de départ ainsi posées, il importe de formuler un certain nombre d'hypothèses nécessaires à la compréhension de l'objet de la présente étude.

- À première vue, disons que la taille du gouvernement aurait un effet négatif sur la démocratie dans la mesure où le gouvernement pris comme un service public aurait autre vocation que la satisfaction de l'intérêt général ;
- Le développement humain contribuerait à l'explication de la démocratie c'est-à-dire, plus les conditions de vie s'améliorent sensiblement (bonne est perçue la démocratie), moins la population s'intéresse à la politique.

### **0.4 Méthodes et Techniques**

Toute recherche scientifique est conditionnée par la combinaison des méthodes et techniques pour parvenir à la lumière sur le questionnement qui fait l'objet d'une étude. Sur ce, nous avons fait recours aux méthodes et techniques ci-après :

#### **0.4.1 Méthodes**

Plusieurs définitions ont été données au terme méthode. Pour éviter la gloutonnerie livresque, nous n'évoquerons ici que deux définitions de ce terme. Dans son sens large, le terme méthode désigne "l'ensemble des démarches que suit l'esprit pour découvrir et démontrer la vérité" (Opanga, 2016-2017, p.48). Les sciences sociales modernes étant caractérisées par



l'empirisme<sup>5</sup> et le raisonnement inductif<sup>6</sup>. Il importe donc de définir la méthode comme étant l'ensemble des opérations intellectuelles permettant d'analyser, de comprendre et d'expliquer la vérité étudiée<sup>7</sup> (Opanga, 2016-2017, p.48).

Pour y arriver, la présente étude a fait recours aux méthodes ci-après : la méthode inductive, la méthode dialectique et la méthode quantitative.

La première part de l'observation des faits de nature empiriques pour dégager des régularités tendanciennes qui apparaissent dans la distribution des fréquences. Elle a permis de tirer une conclusion à partir des observations générales.

La méthode dialectique insiste sur l'historicité des faits sociaux sur leur mouvement engendré par les contradictions qui en constituent le principe (elle est fondée sur la discussion contradictoire pour faire émerger la vérité). Celle-ci a tiré des inférences par rapport au phénomène étudié.

La méthode quantitative nous a permis de procéder à des calculs pour analyser et comparer les différentes variables quantitatives afin de porter un jugement sur leurs conséquences.

Au-delà de toutes ces méthodes classiques, nous ferons également recours à l'outil économétrique pour analyser l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie et/ou l'influence des autres grandeurs économiques dans l'explication de la démocratie. À cet effet, la Méthode des Moments Généralisés (GMM) adaptée aux données de panel avec l'indice de démocratie de Freedom House comme principale mesure d'analyse ensuite avec un autre indice de démocratie de polity IV pour le contrôle de robustesse. La technique GMM nous permet de corriger les problèmes potentiels d'endogénéité et de tenir compte des effets spécifiques fixes pays inobservables et invariants dans le temps (Yi et al, 2013).

---

<sup>5</sup> . (Privilégiant les faits et l'observation) opposé au rationalisme (primat de la raison sur l'observation) et à l'introspection ou la compréhension (privilégiant la conscience subjective des phénomènes) Toutefois, le nécessaire retour au concret ne doit pas signifier ignorance de l'exigence de la théorie et de la conceptualisation, donc de l'abstraction, dans la démarche scientifique.

<sup>6</sup> . (Généralisation à partir des données de l'observation) préféré, ou en tout cas associé, au raisonnement déductif (schéma conceptuel dont on tire les conséquences logiques).

<sup>7</sup> . Analyser, c'est décomposer. Comprendre, c'est établir le réseau de relation entre les variables. Expliquer, c'est répondre à la question "POURQUOI ?". C'est faire voir comment un phénomène est né et comment il est ce qu'il est. L'explication consiste à clarifier les relations entre des phénomènes et à déterminer pourquoi ou dans quelles conditions tels phénomènes ou tels événements se produisent.

## 0.4.2 Techniques

Les techniques sont les outils de la recherche, et impliquent une certaine manipulation matérielle des procédés de collecte des données. Dans le cadre de notre étude, nous avons recouru aux techniques de l'analyse documentaire et les techniques statistiques.

L'analyse documentaire "est une forme d'observation indirecte car médiatisée par les documents" (Opanga, 2016-2017, p.139). Elle a permis à collecter des informations par des lectures de documents existants. Les techniques statistiques nous ont permis d'objectiver notre recherche par le traitement des données quantitatives ou chiffrées.

## 0.5 Choix et Intérêt du Sujet

Depuis l'attribution du prix Nobel à James Buchanan<sup>8</sup> pour ses travaux pionniers sur l'analyse économique des décisions publiques et Elinor Ostrom<sup>9</sup>, dont les thèmes de recherche et la démarche s'inscrivent pleinement dans le courant du public choice. Ces deux prix Nobel couronnent un courant pluridisciplinaire, qui est devenu essentiel à la fois pour la science économique et pour la science politique (Mueller et al., 2010).

Cependant, l'appréhension du choix et l'intérêt de notre sujet est motivée par le souci de converger vers la frontière de la recherche d'une part et d'autre part, par le désir d'apporter notre modeste contribution à ce courant pluridisciplinaire et à controverse.

En dépit de son intérêt vital et capital, la présente étude n'a nullement la prétention d'épuiser tous les aspects de ce courant pluridisciplinaire. Sa modeste ambition se limite à étudier l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie ainsi que l'effet des autres variables d'intérêt sur la démocratie.

---

<sup>8</sup> . Économiste américain, prix Nobel d'économie en 1986 pour le développement de la théorie du choix public (Public Choice theory) qui critique les dysfonctionnements de l'intervention publique et explique les comportements de l'État à partir des agents qui le constituent. Il fait ainsi suite aux premiers travaux effectués par Amilcare Puviani quelques années auparavant.

<sup>9</sup> . Politologue et économiste américaine. En octobre 2009, elle est la première femme à recevoir le prix Nobel d'économie, pour son analyse de la gouvernance économique. Ses travaux portent principalement sur la théorie de l'action collective et la gestion des biens communs ainsi que des biens publics, aussi bien matériels qu'immatériels. Ils s'inscrivent dans le cadre de la nouvelle économie institutionnelle.

Pour clore, nous espérons que notre étude servira d'outil de réflexion susceptible de permettre aux chercheurs et toutes personnes intéressées d'avoir une lecture sur les enjeux de la démocratie et taille du gouvernement. Aussi, cet intérêt se veut académique dans la mesure où nous voulons asseoir nos connaissances et élargir l'espace de notre tente du savoir sur la question traitée.

## **0.6 Délimitation de l'étude**

Tout travail scientifique comporte une délimitation spatio-temporelle pour permettre de bien le positionner car dit-on : " Qui trop embrasse, mal étroit ". De ce fait, notre étude a pour délimitation spatio-temporelle trente-huit pays africains pour une période allant de 2003 à 2018.

Le choix de cet espace est fondé sur notre souci d'apporter une petite pierre à cet édifice par notre réflexion qui va valoir un pesant d'or, car notre étude s'avère importante pour l'Afrique en générale, mais la contrainte liée à la disponibilité des données de certains pays Africains nous impose d'analyser que trente-huit pays sur cinquante-quatre.

Mutatis Mutandis, au choix de la période d'étude, ce dernier s'argue par la disponibilité des données chiffrées.

## **0.7 Subdivision du travail**

Pour une étude efficiente, nous allons de prime abord nous appesantir sur la démocratie et taille du gouvernement (1), avant de graviter sur les données, modèle et méthodologie (2), ensuite finir avec Appréciations critiques et Perspectives (3) qui conduira à une conclusion.

## **CHAPITRE 1 : LA DÉMOCRATIE ET TAILLE DU GOUVERNEMENT**

Ce chapitre examine, d'un point de vue théorique, la relation existante entre démocratie et taille du gouvernement. Il se subdivise en trois sections. La première définit la démocratie en esquissant son état de lieu et en passant en revue sa mesure. La deuxième section s'efforce de définir la taille du gouvernement, faire son état de lieu et présenter sa mesure. Et enfin, la troisième section est consacrée à l'analyse des interactions entre la démocratie et taille du gouvernement.

### **1.1. La démocratie : Théorie et Mesure**

Comme nous l'avons évoqué dans l'introduction de ce travail, le survol de la littérature a montré que la notion de démocratie est apparue dans la réflexion académique d'abord à travers la philosophie politique. Cependant, la démocratie n'a pas reçu l'acquiescement de tout le monde en tant que régime politique à l'unanimité par les athéniens. Ce qui revient à dire que la démocratisation est un processus et rarement, voire jamais un idéal (Carnegie, 2009).

#### **1.1.1. Définition de la démocratie**

Lungungu et Mulopo (2017, p.31) écrivirent qu'il est trop prétentieux de vouloir définir un mot et un concept dont des livres et des traités entiers ont déjà tenté d'expliquer. Mais, pour répondre à l'exigence académique, nous reprenons dans les lignes qui suivent cinq définitions de la démocratie sur toute une panoplie des définitions existantes avant d'en proposer une autre.

De par sa racine étymologique "Dêmos et Kratos", la démocratie veut dire pouvoir du peuple. Ceci sous-tend que le peuple est au cœur de tout pouvoir, il en est le garant.

Schumpeter (1942, p.250) a fait valoir que la démocratie était [...] l'arrangement institutionnel pour arriver à des décisions politiques dans lesquelles les individus acquièrent le pouvoir de décider au moyen d'une lutte compétitive pour les intérêts de vote.

D'après Lipset (1963), la démocratie est un système politique qui, à l'intérieur d'un complexe social, permet le renouvellement légal du personnel dirigeant, et comme un mécanisme social qui permet à une très grande partie de la population d'exercer une influence sur les décisions importantes en choisissant les responsables. De ce qui précède, notons que la souveraineté accordée au peuple est l'élément clé caractérisant la démocratie.

Pour Tocqueville (2008) elle ne désigne pas seulement la participation des citoyens à la gestion de leurs affaires, mais l'égalité de plus en plus grande des conditions.

Selon Capul et Garnier (2015), la démocratie est une organisation politique dans laquelle le peuple souverain a la possibilité d'exercer librement ses droits politiques (choix de vote, liberté d'expression, liberté d'association, etc.). Cette définition laisse croire que la démocratie est le fruit d'un consensus (organisation politique) au cours duquel le peuple s'est vu attribuer la liberté de participer à la vie politique.

Au regard de ces définitions, nous osons définir la démocratie comme étant le régime politique le moins mauvais ; basé sur les réformes institutionnelles où les dirigeants font semblant d'agir pour la plupart de cas, au nom du peuple.

### **1.1.2. Démocratie : Théorie**

#### **La démocratie en perspective historique**

De la Grèce antique à la Rome antique, de l'époque médiévale au siècle des Lumières, du parlementarisme britannique à la Révolution française, la démocratie a parcouru un long chemin avant de devenir ce qu'elle est aujourd'hui.

La perception de la démocratie est différente d'un pays à un autre. La démocratie athénienne, fort différente de nos démocraties modernes ne s'est pas implantée du jour au lendemain. La mise en place d'un régime politique où l'ensemble des citoyens pourrait participer à la prise de décision était inédite en Grèce. C'est donc graduellement que les institutions démocratiques ont vu les jours à Athènes (Auberger, 1996).

De ce qui précède, comprenons que la démocratie athénienne était une démocratie directe où la possibilité était accordée aux citoyens lambda de participer directement à la prise des décisions d'ordre public, contrairement à la démocratie actuelle qui est représentative.

En rapprochement, Mossé (1971) souligne que le 5<sup>e</sup> siècle av. J.-C fut marqué par l'abolition en 509 de la royauté à Rome au profit d'un nouveau régime à savoir, la république. Mot tiré du latin "res publica" qui signifie « chose publique » pour faire référence aux affaires publiques de la cité gérée collectivement par certains groupes de citoyens autorisés à participer à la vie publique. Fort malheureusement, et compte tenu du concept citoyen désignant à Athènes tout individu (adulte) né d'un père citoyen Grec, la citoyenneté à Rome pouvait s'acquérir et une citoyenneté acquise ne s'accompagnait pas des droits sociopolitiques reconnus à tous. Aussi, la classe sociale jouait un rôle primordial dans l'attribution du droit de participer à la vie politique et la possibilité de gérer la chose publique. De ce fait, contrairement à Athènes, la démocratie n'a jamais été instaurée à Rome. L'ensemble des citoyens n'a jamais réellement pu participer directement à la prise de décisions d'ordre public. Néanmoins, la République romaine est basée sur des institutions politiques qui permettent à un certain citoyen de participer à la vie politique. En définitive, disons que la démocratie est fille de la Grèce alors que les institutions politiques sont filles de la Rome.

En dérivation, Machiavel (1531) défend la république et la démocratie bien qu'il montre son admiration pour la Rome antique comme un modèle de gouvernement. Néanmoins, il surenchérit que la Rome antique ne sert pas de modèle en politique. Cependant, Machiavel considère trois types de gouvernement à savoir, les monarchiques, les aristocratiques et les populaires et ajoute trois autres formes de gouvernement qu'il qualifie de mauvais à savoir, les despotiques, les oligarchiques et la démocratie.

Montesquieu (1748) parvient à faire une distinction entre trois types de gouvernement à savoir, le républicain, le monarchique et le despotique. Toutefois, l'auteur note le républicain comme le type de gouvernement auquel le peuple (ou une partie) a la souveraine puissance. Ce type de gouvernement comprend l'aristocratie (lorsqu'une partie du peuple est souveraine) et la démocratie (lorsque tout le peuple est souverain). Il souligne que ces deux composantes de la république ne s'opposent pas essentiellement, puisqu'elles ne sont que deux espèces différentes d'un même genre de régime politique. Dans un régime démocratique les lois qui établissent le

droit de suffrage sont fondamentales car le peuple est à la fois monarque et sujet. Il est monarque par ses suffrages qui sont ses volontés.

Contrairement aux propos de machiavel qualifiant la démocratie d'une mauvaise forme de gouvernement, la pratique révolutionnaire apparue à la fin du XVIII<sup>e</sup> siècle a mis en évidence la démocratie au profit des autres formes de gouvernement. Les grecs ont inventé la démocratie, mais il s'agissait d'une démocratie directe. La démocratie représentative moderne est en revanche l'héritage des révolutions américaine et française (Edelstein, 2014, p.19).

En effet, Rousseau (1762) élabore les fondements de la démocratie moderne en énonçant le principe de souveraineté du peuple que nous retrouvons de nos jours dans de nombreuses constitutions en s'appuyant sur les notions de liberté, d'égalité, et de volonté générale.

Faisant une analyse descriptive du système politique américain, Tocqueville (2008) écrivit déjà en 1835 que la démocratie a une tendance à dégénérer en despotisme mou. Notons que pour cet auteur, la démocratie n'est pas une forme de gouvernement mais un état social caractérisé par l'égalité des conditions. Et ce, la démocratie américaine comportait des faiblesses potentielles à savoir, le despotisme populaire, la tyrannie de la majorité, l'absence de la liberté intellectuelle, la fragilité de l'administration etc. Par ailleurs, il souligne que deux idées forces sont au cœur de la démocratie à savoir, l'égalité et la liberté bien que la première prime sur la seconde et souligne trois principales menaces pesant sur le régime américain à savoir, la tyrannie de la majorité, l'individualisme et le despotisme étatique.

Par contre, la révolution française a joué un rôle décisif dans la culture politique actuelle. Cette révolution a fait des élections le fondement de la légitimité politique, l'expression de la volonté populaire, le mode de sélection du personnel politique et rendu responsables les élus (Edelstein, 2014). Cet angle de la démocratie s'est répandu au point de devenir l'une des mesures de la démocratie actuelle. La philosophie de la démocratie élaborée au XVIII<sup>e</sup> siècle peut être résumée dans la définition suivante : la méthode démocratique est la technique institutionnelle de gestation des décisions politiques qui réalise le bien commun en chargeant le peuple lui-même de faire pencher le plateau de la balance en élisant des individus qui se réunissent ensuite pour accomplir sa volonté (Schumpeter, 1942, p.296). Les idées de Schumpeter sont venues au moment où la démocratie était gravement menacée et présentées une conception réaliste.

Il sied de noter que le débat entre République et Démocratie a structuré l'histoire politique du XIX<sup>e</sup> siècle. Et les deux notions ne se sont finalement retrouvées qu'au terme d'un terrible cycle de guerres et de révolutions, conduites au nom des nations puis des idéologies. La fin du communisme a paradoxalement ouvert de nouvelles interrogations sur leur conciliation. Après une courte période d'euphorie, chacun a réalisé que la démocratie et le marché n'avançaient pas du même pas, voire que la libéralisation et la mondialisation des économies pouvaient présenter des difficultés nouvelles pour l'organisation de la démocratie et l'exercice de la solidarité, dont le cadre demeure l'État-nation (Lancelot et al, 1996, p.82).

Du point de vue français, l'approche républicaine cherche à créer un espace citoyen, c'est-à-dire à établir la liberté et l'égalité en droit. C'est la grande tradition issue de 1789. L'approche démocratique est différente : elle s'efforce de créer, pour reprendre le mot de Tocqueville qui s'est révélé si prophétique, l'égalité des conditions. Ce qui n'est pas le poignet initial de la république (Lancelot et al, 1996, p.83).

La récente traversée qu'a connu l'Argentine, la Bolivie, le Brésil, le Chili, l'Équateur, le Pérou et l'Uruguay, quittant des régimes autoritaires vers la démocratisation dans les décennies 80 et 90, combinée aux efforts de libéralisation politique au Mexique et à la récente élection de présidents civils au Guatemala, au Salvador, en Honduras et au Nicaragua, représente un tournant politique en Amérique latine. Ce constat pousse Lynn (1990) à soulever une préoccupation centrale exprimée par Dankwart A. Rustow il y a près de vingt ans : "Quelles conditions rendent la démocratie possible et quelles conditions font-elle prospérer". La réponse à cette question est que la manière dont les théoriciens de la politique comparée ont cherché à comprendre la démocratie dans les pays en développement a changé, car la recherche autrefois dominante des conditions préalables de la démocratie a cédé la place à un accent davantage orienté sur les processus du choix contingent.

### **Physionomie de la démocratie en Afrique**

L'année 2020 revêt un caractère particulier pour l'Afrique car elle correspond au soixantième anniversaire d'indépendance de dix-neuf États africains qui ont accédé à la souveraineté nationale et internationale en 1960. Avant cette date, l'Afrique était régie, depuis la fin du



XIX<sup>ème</sup> siècle, par des États coloniaux qui se distinguaient particulièrement par leurs caractères paternalistes, coercitifs et illégitimes. Paternalistes, dans la mesure où les États coloniaux s'étaient arrogés la mission de définir et d'apporter la civilisation, le bonheur ou le bien-être aux indigènes des territoires conquis qu'ils traités, du reste comme des enfants. Coercitifs, parce qu'ils imposaient aux autochtones des règles juridiques contraignantes, des travaux forcés et des châtements corporels fondés sur l'arbitraire. Enfin, illégitimes du fait qu'ils n'émanaient pas de la volonté du peuple colonisé. Ce sont des États, créés ex nihilo, qui se sont imposés par la force.

Depuis les indépendances jusqu'à nos jours, l'Afrique a du mal à se défaire du modèle politique hérité de la colonisation. La crise de l'État s'est installée durablement sur le continent. De méthodes d'accès au pouvoir, aux projets de société, en passant par le mode de gouvernance de la chose publique et les relations avec les citoyens, l'État postcolonial n'a pas plus de légitimité que son ancêtre colonial. La persistance voire l'aggravation du sous-développement traduit l'absence ou l'inefficacité de l'État en tant qu'acteur de développement. Par ailleurs, les coups-d'État, la manipulation des lois, la fraude électorale, les guerres ethniques et rébellions, la corruption, le clientélisme, le tribalisme rendent difficile l'émergence de l'État-nation ou de l'État démocratique comme garant de l'intérêt général, de la cohésion sociale et du bien-être de tous. L'Afrique est, au contraire, dominée globalement par des États prédateurs qui servent les intérêts particuliers d'une petite élite au détriment des intérêts collectifs de la majorité de citoyens.

Cet état des faits scelle l'échec du projet étatique en Afrique. Il nous oblige de rappeler qu'au lendemain des indépendances, certains dirigeants africains à savoir, Senghor, Nyerere et Nkrumah ont soutenu l'idée selon laquelle les systèmes politiques africains précoloniaux présentaient quelques traits démocratiques dans lesquels les nouveaux États indépendants pourraient et devraient puiser leur inspiration (Buijtenhuijs et Rijnierse, 1993). Cette opinion de certains pères de l'indépendance est à notre humble avis erroné et semble être à la base des États autoritaires qu'a connus l'Afrique après les indépendances. Assimiler les régimes coloniaux aux régimes démocratiques est à notre avis une erreur, car les deux régimes sont parallèles.

La compréhension de la démocratie n'étant pas uniforme. Les années ayant suivies les indépendances ont été marquées par une crise qui a été désignée par plus d'un comme étant le résultat de l'impréparation de l'élite politique. Fort malheureusement, ce constat amer continue de sombrer l'Afrique jusqu'au moment de cette analyse.

L'approche de la démocratie en Afrique va de pair avec la notion même de l'État tel qu'intégrée par l'imaginaire collectif : les travaux de Jean-Marc Ela (1990) faisant une lecture de l'État postcolonial à partir de la brousse montrent comment la paysannerie organise une riposte multiforme à ses pratiques autoritaires de développement. Si la perspective est intéressante, les résultats des courses à l'arrivée sont un peu décevants.

Jean-Marc Ela va trop vite en besogne en surestimant les capacités de résistance du monde rural africain en affectant d'un fort coefficient politique des comportements polysémiques qui prêtent à toutes sortes d'interprétations où fatalisme et ruse ne peuvent être évacués. Si le monde rural africain est si politisé que cela, alors son absence quasi totale dans les processus de démocratisation en cours reste une énigme à éclairer.

Comme nous l'avons évoqué ci-haut, rappelons que plus d'un demi-siècle après la fin de la colonisation, les régimes démocratiques restent minoritaires sur le continent africain, à en croire les statistiques de Freedom House et de Polity IV. Malgré la mise en place des processus électoraux, la plupart des États sans être forcément autoritaires ou répressifs, ne respectent pas les préceptes de l'état de droit et ne favorisent le maintien au pouvoir d'une élite politique.

Darracq et Magnani (2011, p.839) soulignent que « Depuis 2000, des élections ont été organisées dans quasiment tous les pays d'Afrique. L'existence de processus électoraux formels n'empêche pas certaines dynasties familiales de perdurer. En outre, nombre de scrutins sont émaillés de violences et les crises postélectorales ne peuvent parfois être résolues que par des accords insatisfaisants de partage du pouvoir. Cependant, un certain nombre d'évolutions positives, dans des pays comme l'Afrique du Sud, semblent signaler que la démocratie électorale est en cours d'institutionnalisation en Afrique ».

En parallèle, notons qu'un pays ne peut être démocratique à moins qu'un parti politique ait été observé à perdre du pouvoir. Par conséquent, selon Przeworski et al. (2000), Le Botswana n'a

jamais été une démocratie car, même si tous conviennent que les élections sont libres et équitables, qu'il y a une libre entrée en politique et que le gouvernement est responsable devant le peuple, le Parti démocratique du Botswana a remporté toutes les élections depuis l'indépendance en 1966. Le Japon n'aurait pas été une démocratie pour la plupart de l'après-Seconde Guerre mondiale jusqu'à la perte du Parti libéral-démocrate du pouvoir, et l'Afrique du Sud aujourd'hui n'est pas considérée comme une démocratie parce que l'ANC a formé le gouvernement depuis la fin de l'apartheid.

De Praia à Port Louis, du Cap au Caire; « il y a longtemps, et plus précisément au début de 1989, il n'existait que quatre<sup>10</sup> pays démocratisés ou qu'au moins autorisaient le multipartisme. Partout ailleurs, dominait le monopartisme ou encore, aucun parti n'était autorisé. Aujourd'hui, [...], cette situation a profondément changé : la plupart des États africains se sont plus ou moins convertis au multipartisme et/ou une autre institution qui conduise à une société plus ouverte » (Buijtenhuijs et Rijnierse, 1993). La démocratie s'est du moins instaurée dans la plupart des pays malgré le problème que pose son applicabilité.

De plus, rajoutons que malgré l'instauration de la démocratie en Afrique, il se dégage un bilan de vingt-trois chefs d'États qui ont été forcés à quitter le pouvoir ces deux dernières décennies.

Il ne fait aucun doute que très récemment, soit en 2011, les peuples ont franchi pour une énième fois la rue ; revendiquant le départ des dictateurs de longue haleine comme Ben Ali, Hosni Moubarak et Mouammar Kadhafi. Cette révolution fut désignée par le "printemps arabe"<sup>11</sup> et a fini par emporter les dictateurs susmentionnés. Le vent ayant suivi la chute de ces dictateurs n'a pas eu les mêmes conséquences.

De front, si le départ de Moubarak a eu comme conséquence une transition démocratique, il n'en est pas de même pour les autres pays. En Libye par exemple, ce fut une guerre civile et quatre ans après la révolution tunisienne, de nombreux facteurs qui ont été à l'origine de cette insurrection à savoir, les fortes inégalités entre les classes supérieures et inférieures de la société

---

<sup>10</sup> . Il s'agit ici de l'île Maurice, la Gambie et le Botswana. Le Sénégal aussi peut être capté dans cette catégorie bien que ce pays ait fonctionné pendant quelque temps sur un parti unique.

<sup>11</sup> . Le printemps arabe est un ensemble de contestations populaire, d'ampleur et d'intensité très variable ; qui se produisent dans de nombreux pays du monde arabe à partir de décembre 2010. L'expression Printemps arabe fait référence au printemps des peuples de 1948 auquel il a été comparé, tout comme le printemps de prague.

perdurés. Pour Bouhdiba (2014), Cela peut être un signe d'échec, étant donné que les inégalités ont été l'un des principaux déterminants de la révolution du jasmin<sup>12</sup>. Nous pourrions conclure que les premières années de la démocratie sont très difficiles pour les citoyens, car elles sont porteuses de difficultés économiques dues à l'instabilité politique.

À long terme, il est plus probable que le nouvel environnement démocratique puisse créer un cadre de croissance économique, et donc une réduction des inégalités entre les différentes classes composant la société.

Le printemps arabe laissa un son de cloche qui s'est vite retentit en Guinée Bissau où Carlos Gomes a été renversé, au Mali, Amadou Toumani Touré s'est penché, en République Centre Africaine, François Bozizé s'est incliné puis Michel Djotodia en 2013. Rajoutons qu'en Égypte le président (Mohamed Morsi) issu du processus démocratique qui a vu le jour après la fuite de Moubarak fut évincé par le général Abdel Fattah al-sissi, au Burkina-Faso, Blaise Compaoré fut courbé. Dans certains pays comme la Côte-d'Ivoire, Burundi et en République Démocratique du Congo pour ne citer que ces trois pays, les citoyens ordinaires ont franchi la rue pour demander le départ des dictateurs et/ou d'exiger la tenue des élections voire la vérité des urnes. Soulignons qu'en Côte-d'Ivoire ce fut un contentieux postélectoral entre Alassane Ouattara et Laurent Gbagbo. Ce dernier ayant perdu les élections ne voulait pas céder le pouvoir.

Les exemples susmentionnés sont à notre humble avis les preuves que l'Afrique divague encore en termes de démocratie. De plus, il sied de noter qu'en Afrique, en règle générale, la démocratie est conçue comme étant un régime idéal, mais cette conception est erronée car limitée par la tenue des élections où plusieurs scrutins organisés ces dernières années ont été marqués par des contentieux électoraux ; des violences postélectorales ainsi que d'importants soupçons de fraudes. En définitive, épousons les propos de Anyang'nyong'o (1988, pp.594595) qui s'argue : « L'histoire de l'Afrique au cours des vingt-cinq dernières années montre que le sous-développement ne fait que gagner du terrain, notamment là où la participation est faible

---

<sup>12</sup> . La révolution tunisienne parfois appelée « révolution de jasmin », est une révolution considérée comme essentiellement non violente, qui par une suite de manifestations et de sit-in durant quatre semaines entre décembre 2010 et janvier 2011, a abouti au départ du président de la République de Tunisie, Zine el Abidine Ben Ali, en poste depuis 1987. L'appellation « révolution de jasmin » a fait débat, car elle renvoie aussi à la prise de pouvoir de Ben Ali en 1987 (qualifiée de « révolution au jasmin »). Les Tunisiens préfèrent le nom de « révolution de la dignité » pour qualifier les événements de 2010-2011.

[...]. Les régimes favorables à la participation ont obtenu de meilleurs résultats que les autres, en termes de croissance économique : le Kenya sous Kenyatta par rapport au Soudan de Nemeiry ; la Côte-d'Ivoire sous Houphouët Boigny par rapport au Zaïre de Mobutu. [...]. La démocratie, considérée sous forme "d'élections libres et démocratiques" au sens traditionnel de la démocratie libérale, n'est donc pas une réponse aux problèmes d'instabilité politique de l'Afrique. L'histoire du Nigéria depuis l'indépendance en est une preuve éclatante ».

Pour Acemoglu et Robinson (2006, p.31), ces antipodes « permettent d'expliquer pourquoi certains pays passent à la démocratie alors que d'autres ne le font pas, et pourquoi certains pays restent des démocraties alors que la démocratie s'effondre dans d'autres pays. Les statistiques comparatives peuvent ensuite guider les travaux empiriques et historiques pour comprendre l'incidence de la démocratie ».

### **1.1.3. Démocratie : Mesure**

Le but de ce travail n'est pas d'exposer l'essence de la démocratie en tant que concept philosophique, politique, juridique et sociologique. C'est pour arriver à une meilleure compréhension du phénomène que nous avons recouru précédemment aux approches philosophique, politique, juridique et sociologique de la démocratie pour en saisir l'essence.

Cependant, le présent point a pour but de discuter de la mesure de la démocratie c'est-à-dire la manière dont le phénomène a été quantifié afin de faire l'objet des études empiriques dans la littérature.

#### **Approches métriques de la démocratie**

Le premier défi auquel est confrontée une analyse quantitative des modèles de démocratie est d'élaborer des mesures fiables et informatives. Il y a eu beaucoup de controverse sur cette question en science politique, principalement parce qu'il y a un désaccord sur ce qui constitue en fait une démocratie. Acemoglu et Robinson (2006, p.48). Cependant, de nombreux chercheurs acceptent la définition proposée par Schumpeter (1942, p.250), susmentionnée, qui a fait valoir que la démocratie était [...] l'arrangement institutionnel pour arriver à des décisions politiques dans lesquelles les individus acquièrent le pouvoir de décider au moyen d'une lutte compétitive pour les intérêts de vote.

La littérature économique récente offre plusieurs possibilités méthodologiques d'évaluation et de mesures empiriques de la démocratie dans le monde. Au mieux de notre connaissance, cinq institutions produisent les statistiques en rapport avec la démocratie à savoir, Freedom House, Polity IV, Indice de démocratie ACLP, Indice de démocratie de Economist Intelligence Unit (EIU) et l'indice de démocratie Vanhanen. Cependant, notons que deux d'entr'elles reviennent souvent dans les études empiriques parcourues à savoir, les indices produits par Freedom house et celui produit par polity IV.

### **Indices produits par Freedom House**

Freedom House publie un indicateur des libertés civiles et politiques existant dans 195 pays depuis 1972 en se fondant sur les travaux de Gastil (1978). Les détails sur ces indicateurs sont exposés en long et large dans Freedom House (2019).

En effet, dans la littérature, de nombreux travaux empiriques (Barro, 1996, 1997, 1999 ; Acemoglu, 2008 ; Acemoglu et Robinson, 2006 ; Acemoglu et al, 2004, 2005, 2008 ; Acemoglu et al, 2013, 2014, 2015 ; Goujon, 2008 ; Kotera et al, 2012 ; Sandalcilar, 2013 ; Gandjon, 2017 ; Qiao et al, 2019 etc.) ont utilisé les deux indices produits par Freedom House à savoir, droits politiques et libertés civiles.

### **Indice de droits politiques**

L'indice de droits politiques est établi sur une échelle allant de 1 à 7, « 1 » représente le pays le plus démocratique (démocraties avancées) respectant les critères suivants : La tenue d'élections justes, la présence de partis d'opposition qui peuvent jouer un rôle important, ainsi que le respect des droits des groupes minoritaires. Alors que « 7 » représente le pays le moins démocratique (non libre, absence de principes démocratiques) où les droits politiques sont inexistantes, que ce soit à cause d'un régime oppressif, d'une conjoncture particulière (Ex. Guerre) ou d'une situation d'instabilité provoquée par les activités de groupes violents.

## **Indice de libertés civiles**

Cet indice est établi sur une échelle allant de 1 à 7, 1 représente le niveau de liberté le plus élevé et 7 le plus bas. Les notes les plus basses dans l'échelle sont décernées aux pays respectant les critères suivants : Le respect de la liberté d'expression, ainsi que celui du droit d'assemblée, d'association, d'éducation et de religion. Un État de droit équitable doit également être établi, ainsi qu'une activité économique libre qui favorise l'accès à l'égalité des chances des citoyens. Les notes les plus élevées (6 et 7) sont accordées aux États offrant peu de libertés à leurs citoyens qui vivent dans la crainte de la répression.

De plus, il sied de signaler que dans les travaux susmentionnés (Barro, 1996, 1997, 1999 ; Acemoglu, 2008 ; Acemoglu et Robinson, 2006 ; Acemoglu et al, 2004, 2005, 2008 ; Acemoglu et al, 2013, 2014, 2015 ; Goujon, 2008 ; Kotera et al, 2012 ; Sandalcilar, 2013 ; Gandjon, 2017 ; Qiao et al, 2019 etc.). L'indice de démocratie est obtenu par la moyenne des indices de droits politiques et libertés civiles. Les pays dont la moyenne des droits politiques et des libertés civiles se situe entre 1,0 et 2,5 sont classés comme « pays libres »; les pays avec une moyenne entre 3,0 et 5,0 sont définis comme « partiellement démocratiques » et les pays avec une moyenne entre 5,5 et 7,0 sont des « pays non libres » (Freedom House, 2018).

## **Mesure produite par Polity IV**

Les auteurs précités en ce qui concerne la mesure produite par Freedom House se servent des indices de droits politiques et libertés civiles comme principales mesures et celle de Polity IV comme mesure secondaire.

En effet, le projet Polity IV fournit les caractéristiques et transitions du régime politique pour tous les pays depuis les indépendances (à partir de 1800) jusqu'en 2018. Les statistiques de Polity IV sont fournies par le Center for Systemic Peace (CSP)<sup>13</sup>. Il donne des codes et des taux

---

<sup>13</sup> . Créé en 1997. Ce Centre mène des recherches innovantes sur le problème de la violence politique dans le contexte structurel du système mondial dynamique, c'est-à-dire l'analyse des systèmes mondiaux. Le Centre soutient la recherche scientifique et l'analyse quantitative dans de nombreux domaines liés aux problèmes fondamentaux de la violence dans les relations humaines et le processus de développement sociétaux systémiques. – approche systémique de la paix et de la sécurité internationale. C'est une instance sur la paix sociale et la création d'indicateurs. Site web : [www.systemicpeace.org](http://www.systemicpeace.org). Consulté le 01 Janvier 2020 à 11h4'.

aux caractéristiques administratives des pays en faisant des comparaisons entre eux. Les publications en série de ces études sont nommées « Polity ».

Le premier projet Polity I est élaboré par Gurr (1974), le projet Polity II a été ourdi en 1990, le projet Polity III a été mis en œuvre en 1995 et le projet Polity IV a été révisé en 2000 (Marshall, 2010). Les scores dans les ensembles de données Polity sont des pays codés avec 21 plages de scores allant de « -10 » à « +10 ». « -10 » signifie une forte autocratie ; « +10 » représente une démocratie forte. En d'autres termes, la plage entre 0 et « +10 » signifie la démocratie ; La plage « -10 » à « 0 » signifie autocratie. « 0 » montre l'absence de principes démocratiques ou d'éléments autocratiques ; « +10 » signifie des démocraties fortes ; « -10 » signifie de fortes autocraties. Le score « -66 » dans les indices Polity indique la période à mi-parcours des processus administratifs ; Le score « -77 » signifie la période d'anarchie et le score « -88 » signifie la période de transition. Des codages appartenant à 164 pays existent dans l'ensemble de données Polity IV publié en 2010.

Les études empiriques précitées (Barro, 1996, 1997, 1999 ; Acemoglu, 2008 ; Acemoglu et Robinson, 2006 ; Acemoglu et al, 2004, 2005, 2008 ; Acemoglu et al, 2013, 2014, 2015 ; Goujon, 2008 ; Kotera et al, 2012 ; Sandalcilar, 2013 ; Gandjon, 2017 ; Qiao et al, 2019 etc.) se servent de l'indice composite de polity, qui est la différence entre les indices de démocratie et d'autocratie de polity 2.

La mesure Polity2, provient de la base POLITY IV qui fait partie d'un programme de recherche du Centre pour le Développement International et la Gestion des Conflits (CIDCM)<sup>14</sup> de l'Université de Maryland. Se basant sur les travaux de Gurr (1974), Gurr, Jagers et Moore (1990), Marshall et Jagers (2011) ont décrit cette base des données concernant 186 pays. Polity2 est la somme d'un indicateur composite de démocratie (DEMOC) et d'un indicateur composite d'autocratie (AUTOC). L'indicateur de démocratie capte la concurrence dans la participation politique, la concurrence et l'ouverture (égalité des chances) du recrutement de l'exécutif et les contraintes institutionnelles sur le pouvoir exécutif. Il est compris entre 0 et 10, où 10 caractérise une démocratie pure. Comme l'indicateur de démocratie, l'indicateur d'autocratie a une échelle de 11 points de – 10 à 0 avec – 10 caractérisant une pure dictature autoritaire. Les mêmes variables que l'indicateur DEMOC sont utilisées pour sa construction.

---

<sup>14</sup> . Pour plus de détails voir : <http://www.systemicpeace.org/polity/polity4.htm>. Consulté le 01 Janvier 2020 à 11h18'.



Les mesures produites par Freedom House et Polity IV sont largement utilisées dans les études empiriques.

### **Autres approches métriques de la démocratie**

Dans la littérature il existe plusieurs manières de capter la démocratie mais nous présentons dans les lignes qui suivent deux approches utilisées pour capter la démocratie.

Aidt et Jensen (2013) examinant la démocratisation et la taille du gouvernement : évidence du long 19ème siècle, ont capté la démocratie par le suffrage en le codifiant comme étant égal à 0 pendant les périodes du début du 19e siècle où aucune élection n'étant organisée et par la valeur du suffrage pour l'année au cours de laquelle le pays a envoyé l'échantillon concerné.

Funk et Gathmann (2011), s'interrogèrent si la démocratie directe réduit-elle la taille du gouvernement. Les auteurs se sont servis de nouvelles données historiques des cantons suisses et ont capté la démocratie directe par deux variables : un indicateur binaire égal à « 1 » si un canton a un référendum budgétaire obligatoire en place ; la variable est nulle (0) si le canton n'autorise qu'un référendum budgétaire facultatif ou nul au cours d'une année.

### **Regard critique des mesures de la démocratie**

Il sied de signaler que les différents indices de la démocratie sus évoqués sont limités car la prise en compte des éléments tels que le droit (droit d'association, d'assemblée), la liberté d'expression, la tenue des élections justes, la présence des partis politiques, la concurrence dans la participation politique n'ont pas la même connotation dans le temps et dans l'espace.

À ce propos, les travaux de Amartya Sen et de Rawls évalués par Zwarthoed (2009) nous ont aidé à comprendre les limites des différentes mesures de la démocratie.

Depuis les révolutions américaine et française, la question de l'existence d'une société plus juste représente l'un des grands problèmes de la philosophie politique. Cette question est au cœur des débats publics.

Cependant, Amartya Sen, dans sa théorie de la justice distingue deux familles de pensée. De Hobbes à Kant en passant par Locke et Rousseau, la première "s'est concentrée sur la recherche de dispositifs sociaux parfaitement justes". Elle culminerait avec le philosophe américain John Rawls. Mais il existerait une autre tradition, allant d'Adam Smith à Marx en passant par Condorcet et John Stuart Mill, pour laquelle la question de la justice ne peut être résolue que par "comparaisons entre les divers modes de vie que les gens pourraient avoir" sous l'effet de différentes institutions.

Sen place ainsi l'égalisation des libertés concrètes entre individus au centre de toute quête de justice. Il s'oppose cependant aux philosophes libéraux, qui considèrent que toute diminution des inégalités entravant les libertés serait mauvaise. Pour lui, cette priorité donnée à la liberté ne saurait constituer un absolu, car l'égalité comme la liberté sont appréciées et désirées différemment par les individus. Selon ce "pluralisme raisonné", le progrès de la justice est inséparable de l'approfondissement de la démocratie, entendue comme délibération la plus large possible.

La prise en compte des élections comme pilier de la démocratie dans la composition des indices de celle-ci est un élément dont la réalité diffère d'un endroit à un autre. Cependant, réussir un processus électoral démocratique fait partie de la mise en place d'un système de gouvernement qui veille au respect des droits de l'homme, à l'État de droit et au développement des institutions démocratiques ; Ce qui n'est pas le cas pour la plupart des pays africains.

Acemoglu et al (2019, pp.48-49) pensent que les indices de démocratie existants sont sujets à des erreurs de mesure considérables, ce qui conduit à des changements fallacieux dans les scores de démocratie qui ne correspondent pas aux changements réels dans les institutions démocratiques.

Pour clore, nous sommes sans ignorer qu'il existe un désaccord sur ce qui constitue en fait une démocratie. À défaut de proposer une nouvelle mesure parmi tant d'autres déjà existantes, nous en appelons, tout comme Sen, au renforcement des possibilités démocratiques réelles, afin d'éviter toute ambiguïté sur la mesure de la démocratie.

## **1.2. La taille du gouvernement : Théorie et Mesure**

La problématique de la taille du gouvernement trouve son fondement dans plusieurs faits et théories. Nous avons précédemment écrit que dans les démocraties avancées, il a été démontré que les électeurs considèrent le Président de la République comme le principal responsable des résultats de la politique macroéconomique et pensent que les parlementaires sont plutôt comptables de la politique de redistribution sociale. Ainsi, le Président de la République est-il jugé et réélu (ou non) en fonction de la croissance du PIB ou sa baisse (Alesina et Rosenthal, 1995).

De ce fait, Il est admis qu'aucune société au cours de l'histoire n'a jamais obtenu un niveau élevé de prospérité économique sans gouvernement. Là où les gouvernements n'existaient pas, l'anarchie régnait et peu de richesses accumulées par l'activité économique productive (Vedder et Gallaway, 1998).

Ainsi, L'État devra donc veiller à la nature de ses dépenses au risque de subir la sanction du peuple lors des prochaines élections, car les dépenses publiques inefficaces financées par les impôts impactent négativement sur la croissance économique (Barro, 1996a).

### **1.2.1. Esquisse définitionnelle**

Le parcours de la littérature ne révèle pas une définition claire et nette de la taille du gouvernement. Cependant, Pour Kotera et al (2012, p.2340), « la taille du gouvernement est considérée comme le degré d'intervention gouvernementale pour remédier aux défaillances du marché sachant qu'une intervention excessive peut entraver la concurrence sur le marché, c'est-à-dire les défaillances du gouvernement ». À présent, nous esquissons de définir la taille du gouvernement comme étant le rôle d'un gouvernement dans la vie économique. Les détails auxquels est inspirée cette définition sont exposés au prochain point.

### 1.2.2. Taille du gouvernement : Théorie

#### Analyse spectrale de la taille du gouvernement

Comme nous l'avons effleuré ci-haut, rappelons que la notion de la taille du gouvernement remonte de réflexions académiques à travers la philosophie politique. Le questionnement de Aristote, notamment : « combien y a-t-il de dirigeants (un, plusieurs, ou le plus grand nombre) ; qui en profite le plus ? » (Holeindre et Benoît, 2010, p.329) a donné naissance à la problématique sous examen.

Cependant, Aristote pense que la démocratie ne fonctionne que pour ceux qui la dirigent (membre du gouvernement), c'est-à-dire du Démos, alors que les constitutions droites recherchent le bien de tous. À ce sujet, Platon était plus précis en avançant que la taille adéquate d'une cité serait de cinq mille quarante individus et de ces individus seraient tirés les organisateurs de la cité dont la taille optimale n'a pas été signalée.

Il est de bon droit de revenir plus en détail sur les travaux ayant occasionnés la naissance du gouvernement (État) en organisant (structurant) la société avant de revenir sur la taille de celui-ci. Nous avons précédemment évoqué les travaux fondateurs des théoriciens du contrat social, (Hobbes, 1651 ; Locke, 1690 et Rousseau, 1762) comme étant une réponse à la deuxième question de Aristote. Le contrat<sup>15</sup> social n'est rien d'autre qu'une solution proposée au problème de la justification de la société civile, et non la description d'un type de gouvernement particulier. À présent, revenons sur les caractéristiques que présente ce courant de pensées.

Hobbes (1651) expose sa conception du contrat social dans son ouvrage le Léviathan. Ce dernier est un monstre biblique (Job 3,8 ; Ps 104,26 et Es 27 ,1) dont il est dit qu'aucune puissance sur terre ne lui est comparable. Ce monstre, créature quasi surnaturelle, figure pour Hobbes l'État, cette puissance artificielle, toute puissante, créée par l'homme pour sa propre défense. Pour Hobbes, l'état de nature c'est « l'horrible état de guerre » car l'homme est un loup pour l'homme. De surcroît, il note que l'état de société est rendu nécessaire par l'insécurité de l'état de nature. Le contrat social qui fonde l'état de société est un contrat de soumission. Hobbes refuse de distinguer l'association et la soumission. Pour lui, la seule façon de s'unir,

---

<sup>15</sup> . L'idée de contrat est empruntée au domaine juridique. Du latin "societas", le mot société désigne initialement un contrat par lequel des individus mettent en commun des biens et des activités et tel que les associés s'engagent à partager toute perte ou tout bénéfice qui découlerait de cette association.

c'est de se soumettre à un tiers. Les idées sus évoquées nous poussent à affirmer que pour Hobbes, le contrat social fait appel à l'absolutisme.<sup>16</sup>.

Quant à Locke (1690), dans ses trois Essais sur le gouvernement civil, il expose une version nouvelle de la doctrine contractuelle de l'État. Mais Locke partage avec Hobbes deux soucis : garantir la sécurité et préserver la propriété (permettre à l'individu de jouir tranquillement de ses biens). Pour Locke, l'état de nature est un état d'harmonie et de liberté raisonnable dont il manque la garantie de l'ordre et du bonheur, autrement dit la garantie de la sécurité. Pour ce qui est de l'état de la société, Locke se questionne si pourquoi former une société si l'état de nature est un état de paix et d'harmonie ; si l'état de nature n'est pas un "horrible état de guerre" comme le pensait Hobbes. Contrairement à Hobbes, Locke pense que nul gouvernement légitime (c'est-à-dire librement consenti) ne saurait être un gouvernement absolu. En effet, nul homme ne serait assez fou pour consentir à abandonner tous ses droits, car alors l'état de société serait pire que l'état de nature.

Selon cet auteur, les hommes entrent donc dans l'état civil par un contrat d'association (consentement mutuel) et un contrat de soumission<sup>17</sup> conditionnel. Ces idées ont donné naissance au principe important en démocratie libérale, de la division des pouvoirs<sup>18</sup>.

À en croire Rousseau (1762), les théories du contrat social évoquées précédemment, qu'elles soient absolutistes (Hobbes) ou libérales (Locke), reposent sur l'aliénation totale ou partielle de l'individu. Or, pour lui, le problème est d'abord et avant tout de préserver la liberté. C'est pourquoi il prône « une forme d'association par laquelle chacun s'unissant à tous n'obéisse pourtant qu'à lui-même et reste aussi libre qu'auparavant ».

---

<sup>16</sup> . L'absolutisme est un concept lié aux réactions de régimes politiques centraux, généralement monarchiques, visant à l'affranchissement des contrepoids (parlementaires, traditionnels ou constitutionnels) liés aux premières formes de séparation des pouvoirs qui ont suivi les formes consultatives (droit de remontrance et d'enregistrement des lois). Les qualificatifs d'absolutisme apparaissent quand le pouvoir central se dégage des remontrances et oppose des Vetos aux contre-pouvoirs. L'absolutisme est lié aux périodes de centralisation politique et militaire caractérisées par la consolidation de la souveraineté territoriale des États, d'importants changements d'ordre militaire, l'affaiblissement du droit coutumier, la diffusion du droit romain, la montée du mercantilisme, ainsi qu'une importance accrue du rôle de la cour et surtout du roi dont la sacralité ne se porte plus simplement sur la fonction mais sur la personne physique.

<sup>17</sup> . Par ce contrat de soumission, les individus abandonnent sous condition leur pouvoir de se conserver et le pouvoir de punir au profit du corps politique. Et pour éviter l'abus de pouvoir de la part du corps politique, ces deux pouvoirs ne doivent pas être concentrés entre les mains d'une seule instance.

<sup>18</sup> . Il y a donc, un pouvoir législatif qui a le pouvoir d'assurer la conservation des citoyens en promulguant des lois ; un pouvoir exécutif qui a le pouvoir de punir (Locke ne distingue pas le pouvoir d'appliquer la loi, pouvoir proprement exécutif, de celui de punir le contrevenant, le pouvoir judiciaire). Depuis Locke, la séparation des pouvoirs en législatif, exécutif et judiciaire est traditionnellement considérée par les libéraux comme la meilleure garantie contre l'abus de pouvoir.

## **Rôle économique de l'État**

Pour mieux comprendre les points de vue actuels sur le rôle économique de l'État, il est utile de voir comment la façon de concevoir ce rôle a évolué au cours du temps. Certaines grandes idées apparues aux XVIII<sup>e</sup> et XIX<sup>e</sup> siècles ont joué un rôle central au XX<sup>e</sup> siècle et occupent encore aujourd'hui une place importante (Stiglitz et al, 2018, p.7).

Entre le XVI<sup>e</sup> et XVIII<sup>e</sup> siècle la pensée économique fut dominée par le mercantilisme dont l'idée centrale est fondée sur la croyance à la prééminence des métaux précieux, l'or et l'argent constituant alors le facteur prédominant de la puissance des nations (Capul et Garnier, 2015, p.430). Il faut cependant noter qu'au XVIII<sup>e</sup> siècle en Angleterre et en France le mercantilisme (le pouvoir fort du prince) dominait, pour ensuite laisser la place à l'idée de laissez-faire d'Adam Smith, les États allemands demeuraient dans une pensée plus philosophique et plus juridico-économique avec le caméralisme (Baslé 1991, p.9).

C'est en réponse à cette doctrine qu'A. Smith (1937) écrivit sur le rôle limité de l'État. Pour Smith, la poursuite de l'intérêt individuel entraîne pour chacun un comportement qui a pour effet d'aboutir, au niveau de la nation, à la meilleure organisation économique possible comme si les individus étaient conduits à leur insu par « une main invisible », véritable mécanisme autorégulateur du marché qui permet, grâce à la concurrence, une utilisation optimale des ressources productives. En d'autres termes, De ce qui précède, il appert de ne pas faire intervenir l'État au niveau économique pour ne pas perturber cet ordre naturel spontané fondé sur l'intérêt personnel de chaque individu.

Ce courant prônant le laissez-faire était populaire pendant l'ère de l'industrialisation puisque la plupart des gouvernements étaient corrompus, capricieux, tyranniques et despotiques étant issus, anciennement, de la loyauté européenne et du parlement pour la Grande Bretagne (Hunt et Lautzenheiser 2011, p.399). De ce fait, la justification de restreindre le pouvoir tyrannique du gouvernement sur les décisions économiques, afin d'obstruer ses profits, devenait plausible et acceptable. Le principal argument à l'appui était celui de la liberté pour la masse générale.

Toutefois et dès ses débuts, le système capitaliste n'étant pas complètement autorégulateur et rationnel, la masse générale se trouve la première affectée par les instabilités économiques constantes et par le manque d'emploi et les récessions économiques. De ce fait, les historiens des idées écrivent souvent que Turgot<sup>19</sup> et Adam Smith se contredisent puisque d'un côté ils avancent un « principe de non-intervention » tandis que d'un autre ils proposent de nombreuses mesures publiques. En fait, aucun de ces auteurs n'adhérait au principe selon lequel l'État « ne doit pas intervenir ». Pour Turgot, le principe qui devait diriger l'action de la puissance publique était la « protection des droits naturels », pour Smith c'était la « promotion du bonheur de la communauté » ; la poursuite de ces buts exigeait que l'État intervienne dans certains cas et s'abstienne dans d'autres. (Vergara, 2008, p.149).

Dans la première partie du XXe siècle, l'interprétation du système capitaliste était : une concentration industrielle élevée accompagnée du développement de grandes entreprises et d'une frénésie impérialiste. Le capitalisme était source de mécontentement social et de chaos, ce qui mena à des périodes de grande instabilité économique telle que la Grande Dépression et créa un contexte favorable à la montée du fascisme et à la Première Guerre mondiale. (Hunt et Lautzenheiser, 2011, p.371). Les penseurs économiques provenant de la tradition néoclassique, les « descendants » d'Adam Smith, ne surent pas reconnaître les changements que connurent les pays européens à la fin du XIXe siècle et au début du XXe siècle ; leurs analyses de l'époque ne mentionnent aucune turbulence dans le système économique.

C'est d'ailleurs pour cette raison que John Maynard Keynes décida de réévaluer les théories néoclassiques qu'il trouvait incomplètes, démontrant que le désordre volontaire ne considérerait pas certains aspects essentiels de l'analyse économique, entre autres, l'aspect de la société, sans s'associer aux théories marxistes dont il trouvait le principe de révolution et de prise du pouvoir par la force comme étant un instrument inutile ne pouvant faire autrement que mener au désarroi (Hunt et Lautzenheiser, 2011, p.402). Il réorienta sa propre pensée afin de développer les idées keynésiennes, qu'il comptabilisera dans son livre publié en 1936, *The General Theory of Employment, Interest and Money*. Il fonda ainsi la base du système capitaliste d'après la Seconde Guerre mondiale et poussa à octroyer une protection sociale aux travailleurs.

---

<sup>19</sup> . Anne Robert Jacques Turgot, baron de l'Aulne, souvent appelé Turgot, né le 10 mai 1727 à Paris, où il est mort le 18 mars 1781, est un homme politique et économiste français. Partisan des théories libérales de Quesnay et de Gournay.

De plus, Keynes argumenta que le secteur privé ne prenait pas toujours des décisions économiques efficaces, contrairement à la théorie néoclassique qui disait préconiser l'équilibre des marchés. Ceci pouvait mener à une inefficacité économique requérant une réponse du secteur public par une politique active, surtout en ce qui concernait les mesures de politiques monétaires de la banque centrale et des politiques fiscales du gouvernement afin de stabiliser l'output du cycle économique (Keynes, 1936). Il favorisait un rôle actif du gouvernement dans l'économie, surtout en temps de récession, contrairement aux néoclassiques qui croyaient tout simplement à la main invisible du marché et à un rôle néfaste de l'État, qui aurait déséquilibré les échanges.

De ce qui précède, il y a lieu de résumer que les éléments sus évoqués comme suit : la théorisation de l'intervention des pouvoirs publics dans la vie économique est l'œuvre de Keynes (1936) en réponse à la crise économique de 1929. Contrairement aux classiques, Keynes pense que le marché ne se régule pas spontanément et justifie l'intervention de l'État dans certaines circonstances. L'État doit ainsi prendre des mesures pour améliorer le climat économique, avec une relance de l'économie. L'intervention publique peut prendre différents canaux, notamment les dépenses publiques.

Depuis les travaux de Keynes sur l'intervention étatique, l'un des faits stylés les plus frappants des finances publiques est l'énorme expansion de la taille du secteur public qui a eu lieu au cours des deux derniers siècles, et, qui a poussé les chercheurs d'orienter le débat sur la question de la taille optimale du secteur public et aucun consensus ne semble être trouvé jusque-là. Deux avis s'opposent à ce sujet. D'une part, les chercheurs souhaitent diminuer la taille de l'État en mettant en avant les dangers qu'un État trop important ferait courir aux libertés économique et politique [...] et d'autre part, les chercheurs estiment au contraire que le secteur public est trop limité et qu'il convient d'accroître sa taille. Selon eux, une augmentation des dépenses publiques permettrait de résoudre beaucoup de problèmes, notamment dans les zones urbaines et dans le système éducatif (Stiglitz et al, 2018, p.32).

En dépit de la position adoptée par les économistes dans ce débat, aucun ne conteste que la taille du secteur public se soit considérablement accrue depuis la Première Guerre Mondiale. En effet, En quatre-vingt ans, le poids des dépenses publiques en pourcentage du PIB s'est accru dans la plupart des pays industrialisés, mais de façon parfois très contrastée. Entre 1930 et 2010,



ce poids est passé par exemple de 9 pour cent à 36% aux États-Unis et d'environ 30 pour cent à 56 pour cent sur la même période en France (Stiglitz et al, 2018, p.53).

Après la Seconde Guerre mondiale, la croissance économique rapide fit ralentir l'arrivée de nouvelles théories contredisant le système en place. Même les partis de gauche devinrent plus conservateurs, s'adaptant à la structure (Hunt et Lautzenheiser 2001, p.517), qui devenait alors : le capitalisme versus le communisme. L'idée répandue était que le système capitaliste basé sur les principes de Keynes viendrait éliminer tous les problèmes, manifestant un manque de besoin pour les théories économiques. Les intellectuels libéraux du moment ne voyaient plus de sens au terme « capitalisme », car les États-nations étaient devenus des démocraties politiques et économiques à part entière sans classes sociales et donc sans intérêt pour les analyses et théories de classes, soit la base même de la théorie capitaliste. Keynes ainsi que Samuelson étaient alors les penseurs du moment, tandis que Marx et Veblen, socialistes, se voyaient mis de côté.

Pour Cohen (1984, p.125), au début des années 60, le keynésianisme était la théorie dominante à laquelle faisait explicitement référence l'administration démocrate. En milieu des années 80, la théorie keynésienne s'est cachée. Évoquée nostalgiquement par ceux chez qui elle échoue, ignorée là où elle réussit, la réussite économique à visage de déficit budgétaire a disparu des imaginaires car considérée par certains auteurs comme signe de mégestion (Duverger, 1984).

De plus, ajoutons que les années 1970 et 1980 virent l'arrivée de crises idéologiques, sociales, politiques et économiques par une diminution de croissance, amenant pertes d'emploi et inflation. Cela permit à de nouvelles théories de voir le jour en matière économique : l'école autrichienne et l'école de Chicago prirent beaucoup d'influence et la tradition marxiste revit le jour avec sa tradition critique (Hunt et Lautzenheiser 2001, pp. 519-523).

Par ailleurs, la pensée néo-classique issue du courant classique libéral (Smith, Ricardo, Mill) insiste sur les initiatives individuelles, sur l'importance des échanges et sur un rôle de l'État limité à la correction des déséquilibres sociaux pour augmenter la richesse d'un pays.

La nouvelle école classique prétend ainsi que le keynésianisme peut être dans les faits, mais qu'il ne peut pas être pensé comme théorie. Et s'il ne peut pas l'être comme théorie, comment

un régime démocratique pourrait-il s'en servir ? (Cohen, 1984, p.130). D'après un article de Rosanvallon (1981), la pensée keynésienne fut qualifiée du déjà vu en France étant donné que l'idée de faire du plein emploi la ligne maîtresse de la politique économique, correspond à la vieille idée du droit au travail proclamée par la Révolution de 1848, à l'occasion d'une crise de chômage particulièrement douloureuse et la politique des grands travaux était perçue déjà au dix-neuvième siècle comme un moyen d'action contre le chômage. Cette pensée confirme que l'intervention de l'État pour résorber le chômage dans des périodes de crise est vieille bien que sa théorisation est l'œuvre de Keynes.

Depuis la théorisation de l'intervention de l'État dans la sphère économique par Keynes, la taille du secteur public s'est considérablement accrue comme nous en avons fait allusion précédemment. Durant les trente années ayant suivi la crise de 1929, « l'État était très largement considéré comme instrument destiné à résoudre les problèmes ; aujourd'hui, pour de très nombreuses personnes, le problème c'est l'État » (Rosanvallon, 1981, p.59).

### **1.2.3. Taille du gouvernement : Mesure**

Dans ce point il est question de discuter de la mesure de la taille du gouvernement c'est-à-dire la manière dont le phénomène a été quantifié afin de faire l'objet des études empiriques dans la littérature.

#### **Approche Métrique de la taille du gouvernement**

Aucun chiffre unique ne peut constituer un indicateur adéquat de l'influence de l'État sur l'économie. Il existe néanmoins un indicateur que les économistes trouvent en général très pratique : il s'agit de la part des dépenses publiques en pourcentage du PIB (Produit Intérieur Brut), celui-ci étant habituellement utilisé comme l'indicateur standard de la taille de l'économie d'un pays (Stiglitz et al, 2018, pp.48-49).

En effet, dans la littérature, de nombreux travaux empiriques (Guartney et al, 1998 ; Chen et Lee, 2005 ; Cooray, 2009 ; Yamamura, 2011 ; Shanaka, 2012 ; Facchini, 2013 ; Qiao et al, 2019 etc.) ont utilisé la part des dépenses publiques en pourcentage du PIB comme mesure de la taille du gouvernement.

La taille du gouvernement peut aussi être captée par les dépenses de consommation finale des administrations publiques en pourcentage du PIB et par la part de la population dans le secteur public par rapport à la population totale (Vedder et Gallaway, 1998 ; Samiei et Jalilvand, 2011 et Kotera et al, 2012).

Funk et Gathmann (2011) utilisent les recettes et les dépenses locales des cantons comme variable de la taille du gouvernement. Tsasa et Lokota (2012) se sont servis du nombre de ministres comme variable de la taille du gouvernement en précisant le nombre de postes créés au sein de chaque gouvernement depuis 2006 en République Démocratique du Congo. Aidt et Jensen (2013) ont pris le PIBH et les dépenses par habitant comme mesures de la taille du gouvernement et Qiao et al (2019) ont utilisé l'emploi total du secteur public.

### **Regard critique des mesures de la taille du gouvernement**

Aucun chiffre unique ne peut constituer un indicateur adéquat de l'influence de l'État sur l'économie.

Cependant, les différentes mesures sus évoquées (Mesures Relatives à la taille du gouvernement) sont répandues dans la littérature bien que comportant toutes des écueils.

Comme mentionner à l'état de la question, rappelons qu'il convient de signaler qu'il n'existe pas une façon univoque de mesurer la taille absolue ou relative dans l'économie. De façon générale, quelques indicateurs sont le plus souvent utilisés, à savoir : le ratio des dépenses publiques ou des impôts au PIB ou la population résidente ; la part des emplois publics dans le total des emplois dans une économie. Toutefois, aucun de ces indicateurs ne peut être manié sans se référer au contexte institutionnel du pays concerné. D'où, le besoin d'une analyse comparée pour identifier le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement dans quelques pays d'Afrique.

### 1.3. Revue de la littérature sur le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement

Le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement n'est ni théoriquement définitif ni empiriquement clair. Bien qu'il ressort d'un consensus que Schumpeter est en effet l'un des premiers auteurs à appréhender les incidences sur l'analyse du fonctionnement démocratique de la levée de l'hypothèse de bienveillance des hommes politiques, c'est-à-dire le fait que les hommes politiques poursuivent des objectifs personnels (de carrière, idéologiques, etc.) distincts des objectifs de l'intérêt commun ou général et qu'ils adoptent des stratégies afin de réaliser au mieux ces objectifs (Mueller et al, 2010, p.9).

En parallèle, le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement a été étudié de manière approfondie, mais la présomption que la démocratie est associée peut-être même de façon causale, à la croissance du gouvernement est répandue et plusieurs théories très influentes de la réforme du suffrage sont fondées sur cette hypothèse, mais la réalité est plus complexe (Aidt et Jensen, 2013).

Funk et Gathmann (2011) dans leur article intitulé « la démocratie directe réduit-elle la taille du gouvernement ? Nouvelles preuves de données historiques, 1890-2000 » affirment que dans une démocratie représentative, les incitations des politiciens élus ne sont pas toujours alignées sur les préférences des électeurs. La théorie montre que les référendums et les initiatives donnent aux citoyens le pouvoir de contrôler les politiciens et peuvent apporter de réelles politiques avec les préférences de l'électeur médian.

De plus, cherchant à répondre à la problématique posée : la démocratie directe réduit-elle les dépenses du gouvernement ; la démocratie directe affecte-t-elle la structure verticale du gouvernement ? Les auteurs utilisent le modèle suivant :

$$\log Y_{ct} = \alpha + \beta \text{Referendum} + \gamma \text{Initiative}_{ct} + \lambda' X_{ct} + t_t + \theta_c + \varepsilon_{ct}, \quad (1.1)$$

Avec  $\log Y_{ct}$  = les dépenses ou revenus ; c = Cantons ; t = l'année ;  $X_{ct}$  = désigne d'autres variables de contrôle ;  $t_t$  = l'année ;  $\theta_c$  = effets fixes cantonaux respectifs et  $\varepsilon_{ct}$  = erreur de mesure des dépenses ou revenus.

Les résultats des estimations montrent que la démocratie directe contraint les dépenses des cantons suisses. De plus, les dépenses des cantons sont réduites de 12% par le référendum

budgétaire obligatoire et les exigences de l'initiative électorale de 1% réduisent les dépenses des cantons de 0,6%. Les auteurs trouvent peu de preuves que la démocratie directe au niveau des cantons entraîne une augmentation des dépenses locales ou une décentralisation.

Kotera et al (2012) dans « taille du gouvernement, démocratie et corruption : une enquête empirique » trouvent comme résultat en partant du modèle de référence :

$$Corruption_{it} = \beta_0 + \beta_1 Governmentsize_{it} + \beta_2 Democracy_{it} + \beta_3 Governmentsize_{it} * Democracy_{it} + B_4 DPPer Capita_{it} + B_5 Legal origin_i + u_{it}, \quad (1.2)$$

où  $i$  et  $t$  représentent respectivement le pays et le temps et  $\mu$ , le terme d'erreur.

Les résultats des estimations suggèrent globalement que l'effet de la taille du gouvernement sur la corruption est significativement négatif. Les auteurs soutiennent également qu'une augmentation de la taille du gouvernement peut donner aux politiciens et bureaucrates plus de place pour une plus grande recherche de rentabilités politiques et, par conséquent, la corruption peut s'empirer.

De plus, s'appuyant sur certaines études empiriques, les auteurs notent que le niveau de pénétration de la démocratie dans un pays peut être considéré comme un facteur entraînant la diminution de la corruption dans un pays. En outre, l'augmentation de la taille du gouvernement peut entraîner une diminution du niveau de la corruption si le niveau de la démocratie est suffisamment élevé et, en revanche, peut mener à une augmentation de la corruption s'il est trop bas.

Aidt et Jensen (2013) ont étudié les conséquences de l'extension de la franchise et de la réforme du scrutin sur la taille du gouvernement en Europe Occidentale entre 1820 et 1913. La transformation complexe de l'économie (Institutions financières et Politiques) a conduit à l'expansion des dépenses centrales du gouvernement qui était inférieur à 5% du PIB dans la plupart des pays d'Europe, Amérique du nord et Océanie en 1870 ; aujourd'hui, elle est légèrement inférieure à 20%.

Les auteurs rejettent l'hypothèse selon laquelle le scrutin secret a entraîné une augmentation de la taille absolue du gouvernement, mais laisse ouverte la possibilité qu'il y ait un effet positif sur la taille relative du gouvernement.

Qiao et al (2019) étudiant la décentralisation fiscale et taille du gouvernement en prenant compte du rôle de la démocratie soutiennent l'argument théorique que la décentralisation fiscale a des implications importantes sur la taille du gouvernement, bien qu'il existe des explications concurrentes notamment en supposant que le gouvernement est un agent bienveillant qui répond aux besoins de ses électeurs.

En sus, comparer aux régimes non-démocratiques, les régimes démocratiques sont plus susceptibles de soutenir un gouvernement bienveillant, ce qui signifie que la décentralisation fiscale dans les pays démocratiques est plus susceptible d'améliorer la responsabilité locale, ce qui se traduit par une taille du gouvernement relativement grande. De plus, globalement, la décentralisation est négativement associée à la taille du gouvernement, soutenant la décentralisation comme moyen de promouvoir la concurrence locale, limitant ainsi l'augmentation de la taille du gouvernement. La décentralisation budgétaire dans les pays où le niveau de démocratie est plus faible a un impact négatif sur la taille du gouvernement.

L'approche quantitative confirme l'argument que la décentralisation fiscale est négativement associée à la taille du gouvernement et qu'un niveau plus élevé de la démocratie tend à atténuer l'impact négatif de la décentralisation fiscale.

## **Conclusion du premier chapitre**

Ce chapitre s'est évertué d'aborder la démocratie et taille du gouvernement. Il s'est subdivisé en trois sections à savoir, démocratie : Théorie et mesure, Taille du gouvernement : Théorie et mesure et enfin revue de la littérature sur le lien entre la démocratie et taille du gouvernement.

La première section a consisté à poser les bases théoriques de la démocratie et d'effleurer les différentes mesures de la démocratie existantes dans la littérature. La deuxième section a fixé les bases théoriques de la taille du gouvernement et s'est évertuée d'évoquer les différentes mesures du phénomène sous examen.

In fine, le lien entre la démocratie et taille du gouvernement n'est ni théoriquement définitif ni empiriquement clair. Cependant, nous pouvons garder à l'esprit que la présomption que la démocratie est associée peut-être même de façon causale, à la croissance du gouvernement est répandue et plusieurs théories très influentes de la réforme du suffrage sont fondées sur cette hypothèse, mais la réalité est plus complexe (Aidt et Jensen, 2013).

Ainsi, dans le chapitre qui suit, nous nous gravitons sur les données, modèle et méthodologie.

## CHAPITRE 2 : DONNÉES, MODÈLE ET MÉTHODOLOGIE

Postérieurement à la démocratie et taille du gouvernement, ce chapitre se veut aborder l'approche méthodologique utilisée dans ce travail en présentant les données et/ou leur construction d'une part et d'autre part en décrivant le cadre analytique de la méthode d'estimation économétrique qui sera appliquée au modèle économétrique que nous allons construire.

### 2.1. Données : Source, Description et Statistiques

Dans cette section, il sera question de présenter les données nécessaires pour l'élaboration de ce travail. Nous présentons les données et leurs sources.

#### 2.1.1. Sources et description des données

Une donnée est ce qui est connue et qui sert de point de départ à un raisonnement ayant pour objet la détermination d'une solution à un problème en relation avec cette donnée.

La validité et la véracité de notre analyse se base sur la fiabilité de nos données ainsi que sur un choix pertinent des variables. Afin d'éviter tout biais dans nos résultats.

Dans ce travail, nous essayons d'évaluer l'interaction entre la démocratie et taille du gouvernement. Notre échantillon est composé de 38 pays d'Afrique. L'analyse couvre la période 2003-2018.

Dans le souci de mener une étude robuste, sept variables ont été utilisées, à noter l'indice de démocratie (Freedom House ou Polity IV pour le contrôle de robustesse), les dépenses de consommation finale des administrations publiques en pourcentage du PIB, le produit intérieur brut par habitant, la population active, le contrôle de la corruption<sup>20</sup>, les investissements directs étrangers ainsi que l'indice du développement humain ( $Demo1_t$ ,  $Demo2_t$ ,  $G_t$ ,  $Y_t$ ,  $Pop_t$ ,  $Corr_t$ ,  $I_t$ ,  $IDH_t$ ). Cfr. Tableau 2.1.

---

<sup>20</sup> . Contrôle de la corruption : Reflète des perceptions de la mesure à laquelle les pouvoirs publics sont exercés pour le gain privé, y compris les formes petites et grandes de corruption, comme la "capture" de l'état par des élites et des intérêts privés.



Toutes nos variables n'étant pas sur la même échelle, nous avons transformé les variables  $Y_t$ ,  $Pop_t$  en échelle logarithmique en base 10. Les données pour les variables  $G_t$ ,  $Y_t$ ,  $Pop_t$ ,  $I_t$  proviennent de la base de données de la banque mondiale (2019), laquelle comprend les indicateurs du développement dans le monde (WDI)<sup>21</sup>. Les données sur  $Demo1_t$  nous sont provenues de Freedom House<sup>22</sup>, et  $Demo2_t$  de la base de données de polity IV<sup>23</sup>.

La variable  $Corr_t$  nous provient des indicateurs de Kaufmann (2019) lesquels comprends les indices sur la gouvernance dans le monde (WGI)<sup>24</sup> et enfin, les statistiques sur  $IDH_t$  nous sont provenues de la base de données du PNUD<sup>25</sup>. Le tableau 2.1 présente les variables du modèle.

Tableau 2.1 – Variables du modèle

Variables	Définition	Source
$Demo1_t$	Indice de démocratie	Freedom House (2019)
$Demo2_t$	Indice de démocratie	Polity IV (2019)
$G_t$	Dépenses de consommation finale des administrations publiques en pourcentage du PIB	Banque mondiale (2019)
$Y_t$	Logarithme du PIBH	Banque mondiale (2019)
$Pop_t$	Logarithme de la population active	Banque mondiale (2019)
$Corr_t$	Contrôle de la corruption	WGI (2019)
$I_t$	Investissements directs étrangers	Banque mondiale (2019)
$IDH_t$	Indice de développement Humain	PNUD (2019)

Source : Compilation de l'auteur.

<sup>21</sup> . [URL:http://www.databank.banquemondiale.org/data/databases](http://www.databank.banquemondiale.org/data/databases). Consulté le 25 décembre 2019 à 12h02'.

<sup>22</sup> . [URL:http://www.freedomhouse.org/report/freedom-world-2018-table-countryscores](http://www.freedomhouse.org/report/freedom-world-2018-table-countryscores). Consulté le 25 décembre 2019 à 12h12'.

<sup>23</sup> . [URL:http://www.systemicpeace.org/polity/polity4.htm](http://www.systemicpeace.org/polity/polity4.htm). Consulté le 25 décembre 2019 à 12h30'.

<sup>24</sup> . [URL:http://info.worldbank.org/governance/wgi/home](http://info.worldbank.org/governance/wgi/home). Consulté le 25 décembre 2019 à 12h05'.

<sup>25</sup> . [URL:http://hdr.undp.org/en/data](http://hdr.undp.org/en/data). Consulté le 25 décembre 2019 à 12h45'.

## **2.2. Modèle d'analyse**

### **2.2.1. Bref aperçu de la modélisation en économie**

La montée en puissance de la modélisation constitue l'une des évolutions les plus marquantes connues par l'économie ces dernières décennies, au point d'ailleurs qu'elle se substitue de plus en plus à la théorisation au sens strict et qu'elle représente aujourd'hui une partie majeure de l'activité de l'économiste (Le Gall, 2008, p.211).

Les modèles macro-économétriques sont en général de grande taille, surtout si on les compare au modèle théorique de référence qui a été progressivement abandonné depuis le début des années 1980 pour les raisons suivantes : le coût de maintenance élevé; un certain échec quantitatif (incapacité à prévoir correctement certains retournements conjoncturels (par exemple, les chocs pétroliers)) et un discrédit académique (Ces modèles ont subi à partir du milieu des années 1970 une double critique : la critique de Sims et la critique de Lucas). Fève (2005).

Les modèles ont vu leur taille se réduire fortement (Fève, 2005, p.150). Les solutions issues de modèles macro économétriques peuvent donner lieu à différentes utilisations : prévisions (après chiffrage des exogènes) ; variantes de politiques économiques (dépenses publiques, taxes, transferts), politiques économiques optimales (voir l'opération Optimix en France).

Pour Robert Lucas, le chef de file de la « Nouvelle École Classique », les modèles sont des « systèmes économiques artificiels » qui « peuvent servir de laboratoires dans lesquels on peut tester à des coûts très inférieurs des politiques dont l'expérimentation se ferait à un prix prohibitif dans les économies réelles », « quelque chose que l'on peut faire entrer dans un ordinateur et faire tourner ». Dans le cadre de ces modèles, l'économiste peut alors raisonner, développer des « récits », se livrer à des exercices de prévision, reproduire des faits stylisés, ou simuler des mécanismes et des variantes, dans une perspective positive ou normative (Le Gall, 2008, p.212).

Pour Sims (1980), les modèles macro économétriques imposent des a priori économiques sans aucune justification statistique. Ainsi, l'exogénéité de certaines variables (par exemple, celles

liées à la politique économique) est postulée, mais elle n'est pas testée. Sims propose alors d'utiliser un modèle statistique non-contraint et dynamique, i.e. le modèle Vectoriel Auto-Régressif (VAR).

Malgré le feu croisé des critiques, force est de constater que ces modèles n'ont pas été totalement abandonnés. Plusieurs raisons peuvent être évoquées. Tout d'abord, la portée empirique de certaines critiques (voir la discussion sur la portée de la critique de Lucas) est loin d'être établie et sans une alternative convaincante, du moins au niveau empirique, la modélisation existante garde de sérieux atouts [...]. Ensuite, ces modèles ont su intégrer assez rapidement certains éléments importants de l'économétrie des séries temporelles (non-stationnarité, Co-intégration) de sorte que leurs propriétés dynamiques se sont enrichies. Enfin ces modèles ont incorporé progressivement de nombreux enseignements de la théorie économique (anticipations, fondements micro-économiques), de sorte que certaines critiques académiques n'ont plus nécessairement lieu d'être (Fève, 2005, pp.152-153).

La modélisation constitue un instrument qui, à bien des égards, va dans le sens de la construction d'une « science sociale dure » : par le biais des modèles, l'économie se dote d'un équivalent des cadres expérimentaux auxquels recourent certaines sciences de la nature. Un modèle, en effet, renvoie aux « expériences que nous aimerions réaliser afin de voir si certains phénomènes économiques réels, lorsqu'ils sont isolés artificiellement d'« autres influences », vérifient certaines hypothèses » (Le Gall, 2008, pp.211-212).

### **2.2.2. Construction du modèle d'analyse et Justification du choix des variables**

Nous avons indiqué précédemment que les études empiriques ayant examiné la démocratie et la taille du gouvernement (Funk et Gathmann, 2011; Kotera et al, 2012; Aidt et Jensen, 2013; Qiao et al, 2019) ont examiné respectivement l'effet de la démocratie sur les dépenses du gouvernement, l'effet de la taille du gouvernement sur la corruption en tenant compte du rôle de la démocratie, les conséquences de l'extension de la franchise et de la réforme de vote sur la taille du gouvernement en Europe de l'ouest et enfin l'effet de la décentralisation fiscale sur la taille du gouvernement en mettant l'accent sur le rôle de la démocratie dans septante six pays développés et en développement.

À notre connaissance, aucun article n'a étudié l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie. C'est ainsi que nous nous sommes inspirés de Kotera et al. (2012) pour examiner le lien entre démocratie et taille du gouvernement afin d'étudier l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie. Nous avons retenu deux modèles suivant la mesure de la démocratie. Dans le premier modèle, la démocratie est mesurée par Freedom House<sup>26</sup> sur une échelle de 1 (état libre ou démocratique) à 7 (état autocratique) pour estimer le modèle 1 donné par l'équation 2.1. Le modèle spécifié utilisé dans l'étude est nouveau (l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie), car il contribue à la littérature en offrant des nouveaux éléments de réponses sur le lien entre la démocratie et taille du gouvernement. Ce modèle de démocratie se présente comme suit :

$$Demo1_{it} = \beta_0 + \beta_1 G_{it} + \beta_2 Corr_{it} + \beta_3 IDH_{it} + \beta_4 Y_{it} + \beta_5 I_{it} + \beta_6 Pop_{it} + \mu_{it}, \quad (2.1)$$

où  $Demol_{it}$ , indique la démocratie de Freedom House dont les détails ont été exposés au chapitre 1. Cette variable sera expliquée par les variables suivantes :

$G_{it}$ , qui indique la taille du gouvernement, correspond aux dépenses de consommation finale des administrations publiques (en pourcentage du PIB).

$Corr_{it}$  (Corruption), reflète des perceptions de la mesure à laquelle les pouvoirs publics sont exercés pour le gain privé, y compris les formes petites et grandes de corruption, comme la "capture" de l'état par des élites et des intérêts privés. Cette variable a été prise en compte par Kotera et al (2012) pour spécifier l'effet de la taille du gouvernement et démocratie sur la corruption.

$IDH_{it}$ . Cette variable mesure le développement. Elle a été prise en compte pour vérifier si le développement aurait un effet positif, négatif ou neutre sur la démocratie. Par ailleurs, signalons qu'à la question de savoir si la démocratie améliore-t-elle la qualité de vie des citoyens ? Aucun consensus ne semble être trouvé jusque-là. Bien que certains chercheurs (Boix, 2001 ; Brown et Hunter, 2004 ; Dreze et Sen, 1989 ; Ghobarah et al, 2004 ; Lake et Baum, 2001 ; Lenski, 1966 ; Lipset, 1959 ; Meltzer et Richard, 1981 ; Muller, 1988) ont adopté le consensus selon lequel la démocratie améliore le développement humain. Nous essayons de vérifier la causalité inverse de ce consensus.

---

<sup>26</sup> . Les détails sur cette mesure ont été fournis au chapitre précédent (Cfr. Démocratie : Mesure)

$Y_{it}$  : logarithme du PIB par habitant. Utilisé également comme variable de contrôle par Kotera et al (2012) et Qiao et al (2019) pour mesurer respectivement son impact sur la corruption et sur taille du gouvernement.

Une autre variable prise en compte est  $I_{it}$  (Investissements directs étrangers). Il est théoriquement vrai que les pays fortement démocratiques sont à même de tirer les investisseurs étrangers. Cependant, nous concernant, nous essayons de voir si les investissements étrangers auraient un impact positif, négatif ou neutre sur le niveau de démocratie dans les pays sous étude.

In fine,  $Pop_{it}$  (Logarithme de la population active). Cette variable a été prise en compte par Funk et Gathmann (2011) et Qiao et al (2019) respectivement pour estimer l'effet de la démocratie directe sur les dépenses du gouvernement et l'effet de la décentralisation fiscale sur la taille du gouvernement en mettant l'accent sur le rôle de la démocratie. Pour notre étude, la variable a été prise en compte en postulant que la population est à même d'engendrer une démocratie. L'exemple le plus proche est celui du printemps arabe où les dictateurs de longues haleines ont été obligés par la population à quitter le pouvoir voire d'instaurer les institutions démocratiques.  $\mu_{it}$  désigne le terme d'erreurs.

Les indices  $i$  et  $t$  désignent respectivement les pays ( $i = 1, 2, \dots, 38$ ) et les périodes ( $t_1 = 2003, t_2 = 2004, \dots, T = 2018$ ) et les  $\beta$  sont les paramètres à estimer.

Les détails sur le choix de ces variables restent valables pour le modèle 2 (Équation 2.2) qui sera évoqué subséquemment.

Pour tester la robustesse des résultats, nous avons estimé le deuxième modèle avec Démocratie (Polity 2)<sup>27</sup> comme variable dépendante toujours mais telle que mesuré par polity IV. Cette mesure va de 1 (pays moins démocratique) à 10 (pays plus démocratique) et nous a servi pour estimer le modèle 2 donné par :

$$Demo2_{it} = \beta_0 + \beta_1 G_{it} + \beta_2 Y_{it} + \beta_3 Corr_{it} + \beta_4 IDH_{it} + \beta_5 I_{it} + \beta_6 Pop_{it} + \mu_{it}, \quad (2.2)$$

---

<sup>27</sup> . Les détails sur cette mesure ont été fournis au chapitre précédent (Cfr. Démocratie : Mesure)

Avec  $Demo2_{it}$  : indice de démocratie tel que donné par Polity IV ;  $G_{it}$  : Taille du gouvernement mesuré par les dépenses de consommation finale des administrations publiques (leur ratio au PIB) ;  $Y_{it}$  : croissance économique mesurée par le PIB per capita (en logarithme base 10) ;  $Corr_{it}$  : Perception de contrôle de corruption ;  $IDH_{it}$  : Indice développement humain ;  $I_{it}$  : Investissements directs étrangers (entrées nettes) ;  $Pop_{it}$  : Population active (en logarithme base 10).

Les indices  $i$  et  $t$  désignent respectivement les pays ( $i = 1, 2... 38$ ) et les périodes ( $t_1 = 2003, t_2 = 2004, ...T = 2018$ ) et les  $\beta$  sont les paramètres à estimer.

Notons que les équations génériques susmentionnées (2.1 et 2.2) seront spécifiées de manière hiérarchique, c'est-à-dire nous essayerons d'introduire une variable après l'autre selon l'ordre que nous allons déterminer en vue de capter l'influence de chacune des variables dans l'explication de la démocratie.

In fine, il sied de signaler que si la littérature ne révèle pas une étude visant à analyser l'effet de la taille du gouvernement et/ou des autres grandeurs macroéconomiques sur la démocratie, elle révèle quand-même l'utilisation de l'indice de démocratie de Freedom House et de Polity IV comme variable dépendante dans l'analyse transnationale, en utilisant la méthodologie des données de Panel. (Acemoglu et al, 2008 et Högström, 2013).

## **2.3. Méthodologie d'estimation**

### **2.3.1. Justification de la méthode**

À l'effet d'analyser l'interaction entre la démocratie et la taille du gouvernement en Afrique, nous employons la Méthode des Moments Généralisés (GMM) adaptée aux données de panel pour estimer les modèles 2.1 et 2.2.

Comme nous l'avons dit à l'introduction de notre étude, contrairement aux études empiriques existantes (Funk et Gathmann, 2011 ; Kotera et al, 2012 ; Aidt et Jensen, 2013 ; Qiao et al, 2019), notre étude tient explicitement compte du problème d'endogénéité susceptible d'être engendré par le biais de causalité inverse. À cet effet, nous appliquons la Méthode des Moments Généralisés (GMM : Generalized Method of Moments) proposée par Hansen (1982) et qui

généralise plusieurs autres méthodes notamment la méthode des moindres carrés, la méthode de Maximum de Vraisemblance et la méthode des variables instrumentales.

De plus, l'estimation par la GMM ne nécessite pas de spécifier la distribution des résidus. Elle est beaucoup soumise à la seule contrainte de l'utilisation des variables instrumentales et ce jeu d'instruments doit être orthogonal aux résidus et corrélés aux variables explicatives.

La GMM nous permet de corriger les problèmes potentiels d'endogénéité et de tenir compte des effets spécifiques fixes pays inobservables et invariants dans le temps (Yi et al, 2013).

### **La stationnarité**

Cependant, avant d'estimer nos deux modèles susmentionnés, nous testons s'il existe une éventuelle présence de racine unitaire dans les séries utilisées. Pour ce faire, nous considérons six tests de stationnarité sur données de panel, à savoir : le test de Levin, Lin and Chu (2002) ; le test de Breitung (2000) ; le test de Im, Pesaran and Shin (2003) ; le test de type Fisher utilisant le test ADF, Phillips-Perron et le test de Hadri (2000). De ces tests susmentionnés, seuls quatre tests, à savoir : le test de Levin, Lin and Chu (2002) ; le test de Im, Pesaran and Shin (2003) ; le test de type Fisher utilisant le test ADF et le test de Phillips-Perron seraient considérés pour présenter les résultats.

Pour rappel, il y a non stationnarité lorsque l'espérance et la variance des caractéristiques Stochastiques se trouvent modifiées dans le temps. De manière formelle, un processus stochastique  $Y_t$  est stationnaire si :

$E(Y_t) = \mu, \forall t$  : La moyenne est constante et indépendante du temps ;

$Var(Y_t) = \sigma^2 < \infty, \forall t$  : La variance est finie et indépendante du temps ;

$Cov(Y_t, Y_{t+k}) = E(Y_t - \mu)(Y_{t+k} - \mu) = \rho_k$  : La covariance est indépendante du temps.

Dans le contexte des données de panel, cette définition est généralisée car il faudra prendre en compte plusieurs dimensions temporelles et individuelles tantôt de manière commune (Stratégie 1) tantôt de manière singulière (stratégie 2). Le premier test que nous allons considérer est celui de Levin, Lin and Chu (2002). En effet, ces auteurs utilisent les données en coupe transversale pour tester l'hypothèse nulle ( $H_0$ ) et voir si chaque série temporelle individuelle contient une racine unitaire contre l'hypothèse alternative ( $H_1$ ) selon laquelle la série est stationnaire. Ils notent que contrairement à la distribution non standard des statistiques

de test de racine unitaire pour une série temporelle unique, les statistiques des tests de panel ont des distributions normales militantes, comme dans le cas des données de panel stationnaires.

L'hypothèse maintenue pour formaliser le test de Levin, Lin et Chou est la suivante :

$$\Delta Y_{it} = \delta Y_{it-1} + \sum_{L=1}^{P_i} \theta_{iL} \Delta Y_{it-L} + \alpha_{mi} d_{mt} \varepsilon_{it}, \quad (2.3)$$

$L=1$

Avec  $m=1,2,3$ . Cette hypothèse peut être compartimentée en trois étapes :

Étape 1 : Régression ADF (Performance)

Pour chaque individu  $i$ , nous implémentons la régression ADF

$$\Delta Y_{it} = \delta Y_{it-1} + \sum_{L=1}^{P_i} \theta_{iL} \Delta Y_{it-L} + \alpha_{mi} d_{mt} + \varepsilon_{it},$$

$L=1$  Avec  $m=1, 2, 3$ .

L'ordre de retard  $p_i$  peut varier d'un individu à l'autre. Campbell et Perron (1991) recommandent la méthode proposée par Hall (1990) pour sélectionner l'ordre de décalage approprié: pour une longueur d'échantillon  $T$  donnée, choisir un décalage maximum ordonner  $P_{max}$ , puis utiliser les  $t$ -statistics de  $\hat{\theta}_{iL}$  pour déterminer si un décalage d'ordre plus petit est préféré. (Ces statistiques  $t$  ont une distribution normale standard sous l'hypothèse nulle ( $\theta_{iL} = 0$ ), à la fois lorsque  $\delta_i = 0$  et lorsque  $\delta_i < 0$ ).

Après avoir déterminé l'ordre d'auto régression  $\rho_i$  dans l'équation précédente (Étape 1), nous exécutons deux régressions auxiliaires pour générer des résidus orthogalisés.

Régresser  $\Delta y_{it}$  et  $y_{it-1}$  contre  $\Delta y_{it-L} (L = 1, \dots, P_i)$  et les variables déterministes appropriées,  $d_{mt}$ , puis enregistrer les résidus  $\hat{\varepsilon}_{it}$  et  $\hat{v}_{it-1}$  de ces régressions. Spécialement,

$$\hat{\varepsilon}_{it} = \Delta Y_{it} - \sum_{L=1}^{P_i} \hat{\pi}_{iL} \Delta y_{it-L} - \hat{\alpha}_{mi} d_{mt} \quad (2.4)$$

Et

$$\hat{v}_{it-1} = \Delta Y_{it} - \sum_{L=1}^{P_i} \hat{\pi}_{iL} \Delta y_{it-L} - \hat{\alpha}_{mi} d_{mt}.$$

Pour contrôler l'hétérogénéité entre les individus, nous normalisons davantage  $\hat{\varepsilon}_{it}$  et  $\hat{v}_{it-1}$  par la forme d'erreur standard de régression dans la première équation de l'étape 1.

$$\hat{\varepsilon}_{it} = \frac{\hat{\varepsilon}_{it}}{\hat{\sigma}_{\varepsilon i}}, \quad \hat{v}_{it-1} = \frac{\hat{v}_{it-1}}{\hat{\sigma}_{\varepsilon i}}, \quad (2.5)$$

Où  $\hat{\sigma}_{\varepsilon i}$  est l'erreur standard de régression dans la première équation de l'étape 1. De manière équivalente, il peut également être calculé à partir de la régression de  $\hat{\varepsilon}_{it}$  par rapport à  $\hat{v}_{it-1}$ .



$$\hat{\sigma}_{\varepsilon i}^2 = \frac{1}{T-p_i-1} \sum_{t=p_i+2}^T (\hat{\sigma}_{\varepsilon i} - \hat{\delta}_i \hat{v}_{it-1})^2. \quad (2.6)$$

Etape 2 : Estimation du rapport entre l'écart-type d'innovation à long terme et à court terme pour chaque individu. Sous l'hypothèse nulle d'une racine unitaire, la variance à long terme pour le modèle 1 peut être estimée comme suit :

$$\hat{\sigma}_{yi}^2 = \frac{1}{T-1} \sum_{t=2}^T \Delta y_{it}^2 + 2 \sum_{L=1}^{\bar{K}} W_{\bar{K}L} \left[ \frac{1}{T-1} \sum_{t=2+L}^T \Delta y_{it} \Delta y_{it-L} \right]. \quad (2.7)$$

Pour le modèle 2, nous remplaçons  $\Delta y_{it}$  dans (2.7) par  $\Delta y_{it} - \overline{\Delta y_{it}}$ , où  $\overline{\Delta y_{it}}$  est la valeur moyenne de  $\Delta y_{it}$  pour l'individu  $i$ . Si les données incluent une tendance temporelle (modèle 3), puis la tendance doit être supprimée avant d'estimer la variance à long terme.

Le paramètre de décalage de troncature  $\bar{K}$  peut dépendre des données. Andrews (1991) suggère une procédure pour déterminer  $\bar{K}$  afin d'assurer la cohérence de  $\hat{\sigma}_{yi}^2$ . L'échantillon les pondérations de covariance  $W_{\bar{K}L}$  dépendent du choix du noyau. Par exemple, si le noyau Bartlett est utilisé,

$$W_{\bar{K}L} = 1 - \frac{L}{\bar{K}+1}.$$

Maintenant, pour chaque individu  $i$ , nous définissons le rapport de la norme à long terme à l'écart-type de l'innovation,

$$S_i = \sigma_{y_i} / \sigma_{\varepsilon_i}, \quad (2.8)$$

Etape 3 : Calcul du t-stat de Panel pour toutes les observations transversales et chronologiques afin d'estimer.

$$\hat{\varepsilon}_{it} = \delta \hat{v}_{it-1} + \hat{\varepsilon}_{it}, \quad (2.9)$$

Basé sur un total d'observations  $NT^*$ , où  $T^* = T - P^* - 1$  est la moyenne de nombres d'observations par individu dans le panel, et  $\bar{P} \equiv \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N P_i$  est l'ordre de décalage moyen pour les régressions individuelles ADF. La régression conventionnelle t-Statistic pour tester si  $\delta = 0$  est donnée par,

$$t_{\delta} = \frac{\hat{\delta}}{STD(\hat{\delta})}, \quad (2.10)$$

Où,

$$\hat{\delta} = \frac{\sum_{i=1}^N \sum_{t=2}^T + p_i \hat{v}_{it-1} \hat{\varepsilon}_{it}}{\sum_{i=1}^N \sum_{t=2}^T + p_i \hat{v}_{it-1}^2}, \quad (2.11)$$

$$STD(\hat{\delta}) = \hat{\delta} \bar{\varepsilon} \left( \sum_{i=1}^N \sum_{t=2}^T + p_i \hat{v}_{it-1}^2 \right)^{-\frac{1}{2}}, \quad (2.12)$$

Le test de Breitung (2000), pris en compte dans notre étude renseigne que les tests des stationnarités corrigés en biais ont été suggérés par Levin et al. (2002) et aussi Im et al. (1997) afin de tester l'hypothèse d'une série statistique par rapport à une tendance alternative stationnaire. L'amélioration de la puissance du test est conditionnée par la manière dont le biais est évité.

L'auteur souligne que l'inclusion des tendances spécifiques conduit à une perte de la puissance quand il s'agit des tests LL et IPS. Par contre, la correction du biais s'avère nécessaire pour obtenir une procédure de test raisonnable. L'auteur préfère la Quasi-différence au test de détournement du MCO. L'auteur formalise l'analyse sous un processus autorégressif de la forme suivante :

$$Y_{it} = \mu_i + \alpha_i Y_{i,t-1} + \varepsilon_{it}, \quad (2.13)$$

Où le terme d'erreur  $\varepsilon_{it}$  est supposé non corrélé entre  $i$  et  $t$ . Dans ce modèle, l'hétérogénéité individuelle est représentée par les paramètres spécifiques individuels,  $\mu_i, \alpha_i$  et  $\sigma_i^2 = E(\varepsilon_{it}^2)$ . S'il n'y a pas d'autres hypothèses sur les paramètres, les données pour chaque unité de section peuvent être analysées séparément en exécutant  $N$  régressions différentes. Dans ce cas, nous ne tirons aucun avantage de la mise en commun des données et, par conséquent, l'inférence peut être très inefficace. L'autre extrême est que nous ignorons ensemble une éventuelle hétérogénéité et estimons une régression groupée avec  $\mu_1 = \dots = \mu_N, \alpha_1 = \dots = \alpha_N$  et  $\sigma_1^2 = \dots = \sigma_N^2$ .

$$\text{Partant de l'équation (2.13), } Y_{it} = \mu_i + \beta_i t + x_{it}, \quad (2.14)$$

avec  $t = 1, 2, \dots, T$  et  $X_{it}$  un processus autoregressif generateur tel que :

$$X_{it} = \sum_{k=1}^{\rho+1} \alpha_{ik} x_{i,t-k} + \varepsilon_{it} \quad (2.15)$$

Partant de l'hypothèse nulle ( $H_0$ ), le processus de difference de stationnarité de l'équation (2.15) est :

$$H_0 : \rho_i = \sum_{k=1}^{\rho+1} \alpha_{ik-1} = 0 \text{ pour tout } i = 1, \dots, N.$$

Dans l'alternative, nous supposons que  $Y_{it}$  est (tendance) stationnaire, c'est-à-dire,  $\rho_i < 0$  pour tout  $i$ .

Les hypothèses concernant  $\varepsilon_{it}$  garantissent l'existence d'un théorème de limite fonctionnelle tel que  $T^{-1/2} \sum_{t=1}^{[rT]} \varepsilon_{it} \Rightarrow \bar{\sigma}_i W_i(r)$ ,

Où  $W_i(r)$  est un mouvement brownien,  $\bar{\sigma}_i^2 = \lim_{T \rightarrow \infty} E(T \bar{\varepsilon}_i^2)$  et  $\bar{\varepsilon}_i = T^{-1} \sum_{t=1}^T \varepsilon_{it}$ .

Le paramètre  $\bar{\sigma}_i^2$  est parfois appelé “variance à long terme”, car il est calculé comme  $2\pi$  fois la densité spectrale à la fréquence zéro.

Le test de Im, Pesaran and Shin (2003), la moyenne de statistiques de la racine d’unité individuelle des données dynamiques hétérogènes étaient au pinacle dans ce papier. Le test t-bar standardisée faisait l’affaire dans l’analyse de la stationnarité (ADF). Les auteurs soulignent que la régression ADF est performante au test t-bar sur un petit échantillon. Ils estiment que celui-ci est meilleur que le test proposé par Levin et Lin.

L’hétérogénéité de l’hypothèse alternative,  $H_1$ , conduit à dire que le rejet de l’hypothèse nulle n’implique pas nécessairement que la racine unitaire est rejetée pour tout  $i$ , mais seulement que l’hypothèse nulle est rejetée pour  $N_1 < N$ , membres du groupe lorsque  $N$  tend vers l’infini.

Notons que le processus stochastique,  $Y_{it}$  est généré par le processus autorégressif d’ordre 1 :

$$Y_{it} = (1 - \phi_i)\mu_i + \phi_i y_{i,t-1} + \varepsilon_{it}, \quad (2.16)$$

Avec  $i = 1, \dots, N$ ,  $t = 1, \dots, T$ ; lorsqu’on s’intéresse à l’hypothèse nulle où les valeurs initiales,  $Y_{i0}$ , sont données. Nous souhaitons tester l’hypothèse nulle de racines unitaires  $\phi_i = 1 \forall i$  (Cfr. Equation 2.14) peut être exprimé comme :

$$\Delta y_{it} = \alpha_i + \beta_i y_{i,t-1} + \varepsilon_{it}, \quad (2.17)$$

Où  $\alpha_i = (1 - \phi_i)\mu_i$ ,  $\beta_i = -1(1 - \phi_i)$ , et  $\Delta y_{it} = y_{it} - y_{i,t-1}$ . L’hypothèse nulle de racines unitaires deviennent alors :

$$H_0 : \beta_i = 0, \forall i, \quad (2.18)$$

Contre l’hypothèse alternative :

$$H_0 : \beta_i < 0, i = 1, 2, \dots, N_1, \beta_i = 0, i = N_1 + 1, N_1 + 2, \dots, N, \quad (2.19)$$

Cette formulation de l’hypothèse alternative permet à  $\beta_i$  de faire la différence entre les groupes, et est plus générale que l’hypothèse alternative homogène, à savoir  $\beta_i = \beta_i < 0, \forall i$ , ce qui est implicite dans l’approche de test de Quah et Levin et Lin (LL). Il permet également certaines (mais pas toutes) des séries individuelles d’avoir des racines unitaires sous l’hypothèse alternative. Formellement, nous supposons que dans l’hypothèse alternative la fraction des

processus individuels qui sont stationnaires est non nulle, à savoir si  $\lim_{n \rightarrow \infty} (\frac{N_1}{N}) = \delta, 0$

$< \delta \leq 1$ . Cette condition est nécessaire pour la cohérence des tests de racine unitaire du panel.

Depuis les travaux précurseurs de Levin et Lin en début des années 1990, le recours aux tests de racine unitaire sur données de panel est devenu très courant dans les recherches empiriques ayant de plus en plus accès aux données de panel. À cet effet, Maddala et Shaowen (1999) notent qu'il est, à ce jour, généralement admis que les tests de racine unitaire couramment utilisés tels que les tests de Dickey-Fuller (DF), de Dickey-Fuller augmenté (ADF) et de Phillips-Perron (PP) manquent de puissance pour distinguer l'hypothèse de la présence de racine unitaire (hypothèse nulle) des hypothèses alternatives; et que le recours aux tests de racine unitaire de données de panel est un moyen d'accroître la puissance des tests de racine unitaire basés sur une seule série temporelle.

C'est notamment sous cette perspective que Maddala et Shaowen (1999) se proposent de comparer les tests de racine unitaire de données de panel de Levin-Lin (LL) et d'Im- Pesaran Shin (IPS) avec le test de Fisher, suggéré il y a plus de soixante ans par R. A. Fisher. La principale conclusion établie par les auteurs est que le test de Fisher est simple et facile à utiliser et constitue un meilleur test que les tests LL et IPS. Certains autres tests conservateurs (applicables dans le cas des tests corrélés), basés sur la correction de Bonferroni,<sup>28</sup>, se sont également avérés inférieurs au test de Fisher.

Finalement, le test de Hadri (2000), considéré également dans notre analyse, se fonde sur l'idée que le multiplicateur de Lagrange basé sur les résidus pour une valeur nulle peut renseigner sur la stationnarité des variables ou des séries. Pour tester l'hypothèse de stationnarité autour d'une tendance linéaire, par rapport à l'alternative d'une racine unitaire dans un panel. Deux modèles sont considérés dans ce contexte :

$$Y_{it} = r_{it} + \varepsilon_{it}, \quad (2.20)$$

Et

$$Y_{it} = r_{it} + \beta_{it} + \varepsilon_{it}, \quad (2.21)$$

Où  $r_{it}$  est une marche aléatoire :

$$Y_{it} = r_{it-1} + \mu_{it},$$

Où  $y_{it}, t = 1, \dots, T$  et  $i = 1, \dots, N$  sont les séries observées pour lesquelles nous souhaitons tester la stationnarité pour tout  $i$ ,  $\varepsilon_{it}$  et  $\mu_{it}$ . sont mutuellement indépendantes et normales et i.i.d. sur  $i$  et sur  $t$  avec  $E[\varepsilon_{it}] = 0$ ,  $E[\varepsilon_{it}^2] = \sigma_\varepsilon^2 > 0$ ,  $E[u_{it.}] = 0$  et  $E[\sigma_u^2] = \sigma_u^2 \geq 0$ .

---

<sup>28</sup> . Du nom du mathématicien italien Carlo Emilio Bonferroni (1892-1960), cette méthode a été développée par la mathématicienne et statisticienne américaine Olive Jean Dunn (1915-2008) pour corriger le seuil de significativité lors de comparaisons multiples.

Le modèle 2 (Équation 2.21) comprend des effets fixes et des tendances individuelles. L'hypothèse stationnaire est simplement  $\sigma_u^2 = 0$ . Puisque les  $\epsilon_{it}$ , sont supposés i.i.d. alors sous l'hypothèse nulle  $y_{it}$  est stationnaire autour d'un niveau dans le modèle 1 (2.20) et la tendance stationnaire dans le modèle 2. Après réaménagement, il y a lieu d'écrire le modèle 2 comme suit :

$$\begin{aligned} Y_{it} &= r_{io} + \beta_i t + \sum_{t=1}^t u_{it} + \epsilon_{it}, \\ &= r_{io} + \beta_i t + e_{it}, \end{aligned} \quad (2.22)$$

Où :  $e_{it} = \sum_{t=1}^t u_{it} + \epsilon_{it}$ . On en déduit

$$E[e_{it}] = 0,$$

Et

$$\begin{aligned} E[e_{it}e_{js}] &= \min(t, s) \sigma_u^2 + \sigma_\epsilon^2 \quad i = j, t = s, \\ &= \min(t, s) \sigma_u^2 \quad i = j, t \neq s, \\ &= 0, i \neq j, t = s, \\ &= 0, i \neq j, t \neq s. \end{aligned} \quad (2.23)$$

$$E(e_{it}) = E\left(\sum_{t=1}^t v_{it} + \epsilon_{it}\right) = 0. \quad (2.24)$$

### 2.3.2 Méthode d'estimation économétrique

#### Implémentation mathématique de la GMM

Considérons un modèle général donné par :

$$\begin{cases} y = x\beta + \varepsilon \\ E\{\varepsilon|X\} = 0 \\ E\{\varepsilon\varepsilon'|X\} = \sigma^2\Omega \end{cases}$$

Où  $y$  est un vecteur de format  $N \times 1$  ;  $X$  une matrice de variables aléatoires de plein rang et de format  $N \times K$  ;  $\beta$  un vecteur  $K \times 1$  ;  $\varepsilon$  un vecteur  $N \times 1$  et  $\Omega$  une matrice de format  $N \times N$  symétrique et semi-définie positive.

Ce modèle est caractérisé par les hypothèses suivantes :

- Linéarité (H1) : L'équation à estimer est linéaire :  $y = X\beta + \varepsilon$
- Stationnarité ergodique (H2) : Soit  $Z_t$  un vecteur d'instruments de dimension  $L$  et  $W_t$

une variable, élément unique de  $(y_t, X_t, Z_t)$ , est conjointement stationnaire et ergodique.

- Condition d'orthogonalité (H3) : Toutes les  $L$  variables  $Z_t$  sont prédéterminées telles que :

$$\mathbb{E}\{Z_{lt}\varepsilon\} = 0 \quad \forall t, \forall l (l=1,2,\dots,L)$$

$$\Leftrightarrow \mathbb{E}\{Z_{lt}(y - X_t\beta)\} = 0$$

$$\Leftrightarrow \mathbb{E}\{g_t\} = 0 \text{ avec } g_t \equiv Z_{lt}\varepsilon$$

- Condition de rang pour identification (H4) : La matrice  $\mathbb{E}\{Z_t X_t'\}$  de format  $L \times K$  est de plein rang et  $g_t$  dépend des données  $W_t$  et du vecteur paramétrique  $\beta$  i.e.

$$g_t \equiv Z_{lt}\varepsilon = g(W_t, \beta) \equiv Z_{lt}(y - X_t\beta),$$

De ce fait, la condition d'orthogonalité devient :

$$E\{g(W_t, \beta)\} = 0, \quad (2.25)$$

Soit  $\beta_0$  une valeur hypothétique de  $\beta$  tel que le système de  $L$  équations simultanées soit :

$$E\{g(W_t, \beta_0)\} = 0, \quad (2.26)$$

La condition d'orthogonalité (Équation 2.25) implique que la vraie valeur du vecteur paramétrique solutionne le système d'équations simultanées (Équation 2.26). Ainsi, les hypothèses établies garantissent l'existence d'une solution au système d'équations simultanées. Et donc, à chaque fois, le vecteur de coefficients sera identifié si  $\beta_0 = \beta$  est l'unique solution du système en cause.

Puisque le modèle considéré est linéaire, la fonction  $g(W_t, \beta_0)$  sera également linéaire en  $\beta$  car pouvant s'écrire comme :  $g(W_t, \beta) = Z_{tY} - Z_t X_t \beta$ .

Il s'en suit que le système (2.26) comprend  $L$  équations linéaires :

$$\mathbb{E}(Z_{tY}) - \mathbb{E}(Z_t X_t) \beta_0 = 0$$

Cette équation admet comme solution unique tel que  $\beta_0 = \beta$  vu que la matrice  $E(Z_t X_t)$  est de rang complet (cfr. H4).

Par ailleurs,  $\text{rang } E(Z_t X_t) < K$ ,  $L < K$ , et donc une condition nécessaire pour l'identification est que le nombre d'instruments ( $L$ ) dit encore nombre des conditions d'orthogonalité soit supérieur au nombre des régresseurs ( $K$ ) dit encore nombre des paramètres. C'est la condition d'ordre pour identification.

Ainsi, si :

- $K > L$  : le système est sur-identifié ;
- $K = L$  : le système est juste-identifié ;
- $K < L$  : le système est sous-identifié.

### GMM linéaire en panel

Pour estimer les deux modèles en données de panel, nous avons utilisé la méthode de moments généralisés pour se préserver de la potentielle endogénéité des variables telles que la corruption, taille du gouvernement etc. Soit le modèle linéaire en panel :

$$Y_{it} = X_{it}\beta + v_{it}, \quad (2.27)$$

Où  $Y$  est un vecteur de la variable dépendante ;  $X_{it}$  peut contenir des régresseurs invariants dans le temps et un intercept ;  $\beta$  un vecteur de paramètres et  $\mu$ , le terme d'erreurs.

Considérons, pour de raisons de simplification qu'il n'y a pas d'effet individuel  $\alpha_i$  ;  $X_{it}$  comprend seulement des variables des périodes courantes (pas de décalage).

Pour un pays  $i$  avec  $T$  observation, on peut avoir l'équation suivante :

$$y_i = x_i\beta + \mu_i, \quad (2.28)$$

Si on remet temporairement les effets individuels  $\alpha_i$ , le modèle (2.27) devient :

$$y_{it} = \alpha_i + X'_{it}\beta + \varepsilon_{it}, \quad (2.29)$$

Certains régresseurs dans  $x_{it}$  sont supposés endogènes, donc  $\mathbb{E}[x_{it}(\alpha_i + \varepsilon_{it})] \neq 0$ .

On appelle Effets aléatoires s'il existe des instruments  $Z_i$  tels que  $\mathbb{E}[Z'_i(\alpha_i + \varepsilon_{it})] = 0$ , alors on applique GMM selon les formules usuelles.

On appelle effets fixes, s'il est seulement possible de trouver des instruments tels que  $\mathbb{E}[Z'_i\varepsilon_{it}] = 0$ , mais  $\mathbb{E}[Z'_i\alpha_i] \neq 0$ . Dans ce cas, il faut éliminer les effets fixes par différentiation et seuls coefficients des régresseurs variables dans le temps sont identifiés.

Revenons au modèle sans  $\alpha_i$  (on est soit en présence des effets aléatoires, soit en présence des effets fixes) et supposons une matrice  $T \times r$  d'instruments  $Z_i$  avec  $r \geq K$  le nombre d'instruments et les conditions de moment sont telles que :

$$\mathbb{E}[Z'_i u_i] = 0, \quad (2.30)$$

Alors l'estimateur GMM en panel peut être trouvé en minimisant la forme quadratique suivante :

$$\begin{aligned} & \text{Min} \left[ \frac{1}{T} \sum_i Z'_i u_i \right]' W_t \left[ \frac{1}{T} \sum_i Z'_i u_i \right] \\ \Leftrightarrow & \text{Min} \left[ \frac{1}{T} \sum_i Z'_i (y_i - x_i \beta) \right]' W_t \left[ \frac{1}{T} \sum_i Z'_i (y_i - x_i \beta) \right] \end{aligned}$$

Les conditions du premier ordre donnent :

$$\begin{aligned} \frac{\partial(.)}{\partial \beta} &= \left( \sum_i x'_i Z_i \right) W_t \left[ \left( \sum_i Z'_i y_i \right) - \left( \sum_i Z'_i x_i \right) \beta \right] = 0 \\ \Leftrightarrow & \left( \sum_i x'_i Z_i \right) W_t \left( \sum_i Z'_i y_i \right) = \left( \sum_i x'_i Z_i \right) W_t \left( \sum_i Z'_i x_i \right) \beta \\ \Leftrightarrow & \hat{\beta}_{\text{PGMM}} = \left[ \left( \sum_i x'_i Z_i \right) W_t \left( \sum_i Z'_i x_i \right) \right]^{-1} \left( \sum_i x'_i Z_i \right) W_t \left( \sum_i Z'_i y_i \right) \end{aligned}$$

Avec  $W_t$  une matrice de poids ou encore matrice de distance, à attacher aux différents moments afin de rapprocher ces derniers le plus possible de zéro. Cette matrice peut être estimée par la matrice de White (1980) i.e. un estimateur convergent de la matrice inverse de variance théorique non conditionnelle des moments.

Cet estimateur trouvé est consistant pour autant que les conditions de moment (6) tiennent.

Lors de l'estimation du modèle de panel avec GMM, trois cas peuvent se présenter :

- Le cas où  $r < K$ , le Panel GMM est dit *sous-identifié*.
- Le cas où  $r = K$ , donc  $\dim(z) = \dim(x)$ , le Panel GMM est dit *juste-identifié* alors  $\hat{\beta}_{\text{PGMM}}$  se simplifie en l'estimateur VI (variables instrumentale) quel que soit la matrice de distance  $W_t$  :

$$\hat{\beta}_{\text{VI}} = \left[ \left( \sum_i x'_i Z_i \right) \right]^{-1} \left( \sum_i Z'_i y_i \right)$$

S'il existe des régresseurs exogènes, ils peuvent jouer le rôle de leurs propres instruments.

- Le cas où  $r > K$  i.e. il y a plus d'instruments que de régresseurs, le Panel GMM est dit *sur-identifié*, dans cas, il faut tenir compte de la matrice de poids  $W_t$ . Par ailleurs, il faut signaler que l'estimation de la matrice de poids optimal est délicate. Ainsi, pour l'estimer on peut recourir à des méthodes computationnelles et parmi ces méthodes, on peut trouver :

- La méthode de moindres carrés en deux étapes (2-step least square) : En cas d'hypothèses homoscédastiques et non autocorrélation des erreurs et dans ce cas, l'estimateur sera donné par :



$$\hat{\beta}_{2SLS} = [x'Z(Z'Z)^{-1}Z'x]^{-1}(x'Z)(Z'Z)^{-1}(Z'y)$$

Ici, la matrice de poids est estimée par  $W_t = \left[ \hat{\sigma}^2 \frac{1}{N} Z'Z \right]^{-1}$

- La méthode de moments généralisés en deux étapes (2-Step GMM), plus robuste en cas d'hétéroscédasticité et présence d'autocorrélation. Dans ce cas, l'estimateur sera donné par :

$$\hat{\beta}_{2SLS} = [x'Z\hat{S}^{-1}Z'x]^{-1}(x'Z)\hat{S}^{-1}(Z'y)$$

Avec  $\hat{S}$  un estimateur robuste de type white donné par  $\hat{S} = \frac{1}{T} \sum_i Z'_i \hat{u}_i \hat{u}_i' Z_i$

Dans la pratique, il est parfois difficile de trouver les instruments  $Z_i$ . Dans la littérature, on se sert des valeurs retardées des régresseurs endogènes et/ou exogènes comme variables instrumentales. On peut souvent supposer que le premier retard de chaque régresseur est non-corrélé avec l'erreur courante, donc  $x_{it-1}$  sont disponibles comme instruments additionnels pour  $x_{it}$  appelé exogénéité faible/instruments prédéterminés. On peut souvent poursuivre ainsi avec 2 retards, 3 retards, etc. On perd chaque fois une période d'observation, mais on augmente le nombre d'instruments, donc l'efficacité augmente.

Le modèle est alors très facilement sur-identifié et cela fait que même si on n'a pas d'endogénéité, panel GMM donnera un estimateur plus efficient que moindres carrés.

Pour tester si les instruments choisis sont orthogonaux aux termes d'erreurs ou pas on recourt au test de Sargan-Hansen. Sous l'hypothèse nulle, on teste si les instruments sont valides. Pour cela, il est question de calculer la statistique J-Hansen donnée par :

$$J_T = T \left[ \frac{1}{T} \sum_i Z'_i \hat{u}_i \right]' W_t \left[ \frac{1}{T} \sum_i Z'_i \hat{u}_i \right]$$

$J_N \xrightarrow{L} \chi^2(K-L)$  sous l'hypothèse nulle et  $\hat{W}_t$  est l'estimateur de la matrice de poids optimale. Naturellement, pour procéder à ce test, on doit être en présence d'une sur-identification, sinon par construction, les conditions d'orthogonalités établies seront satisfaites. D'où le nom de test de sur-identification.

## Conclusion du deuxième chapitre

Le présent chapitre s'est proposé d'aborder l'approche méthodologique utilisée dans ce travail en présentant les données et/ou leur construction d'une part et d'autre part en décrivant le cadre analytique de la méthode d'estimation économétrique qui sera appliquée au modèle économétrique que nous allons élaborer.

La première section a porté sur données : sources, description et statistique. Il sied de noter que sept variables ont été utilisées, à noter l'indice de démocratie (Freedom House ou Polity IV pour le contrôle de robustesse), les dépenses de consommation finale des administrations publiques en pourcentage du PIB, le produit intérieur brut par habitant, la population active, le contrôle de la corruption, les investissements directs étrangers ainsi que l'indice du développement humain, ( $Demo1_t$  ou  $Demo2_t$ ,  $G_t$ ,  $Y_t$ ,  $Pop_t$ ,  $Corr_t$ ,  $I_t$ ,  $IDH_t$ ).

La deuxième section s'est évertuée d'aborder le modèle d'analyse. Dans cette section nous construisons nos modèles d'analyse à la question d'interaction entre la démocratie et taille du gouvernement puis nous justifions le choix porté sur différentes variables sus évoquées.

In fine, la troisième section s'est basée sur la méthodologie d'estimation à laquelle notre étude aura fait recours au précédent chapitre. Nous avons tour à tour exposé les détails sur les tests de stationnarité de données de panel, à savoir le test de Levin, Lin and Chu (2002); le test de Breitung (2000); le test de Im, Pesaran and Shin (2003); le test de type Fisher utilisant le test ADF, Phillips-Perron et le test de Hadri (2000) ainsi que la méthodologie économétrique à laquelle cette étude aura fait recours au chapitre suivant à savoir la méthode de moments généralisés pour se préserver de la potentielle endogénéité des certaines variables prises en compte dans notre travail.

Ainsi, dans le chapitre qui suit, nous nous gravitons sur les résultats, discussions et recommandations des politiques.

## **CHAPITRE 3 : APPRÉCIATIONS CRITIQUES ET PERSPECTIVES**

Ce chapitre finalise l'analyse entreprise au premier chapitre (la démocratie et taille du gouvernement), suivi par données, modèle et méthodologie (deuxième chapitre). Le présent chapitre se veut présenter les résultats auxquels cette étude a abouti, leurs discussions ainsi que les recommandations des politiques.

### **3.1. Résultats et validation d'estimation**

#### **3.1.1. Résultat de la stationnarité des variables**

L'estimation d'un modèle avec les données macroéconomiques (séries temporelles ou Panel), passe par le test de stationnarité pour se rassurer de l'ordre d'intégration de différentes séries sous examen.

Pour ce faire, le présent travail fera recours à quatre tests de stationnarité de données de panel, à savoir : le test de Levin, Lin and Chu (2002); le test de Im, Pesaran and Shin (2003); le test de type Fisher utilisant le test ADF et Phillips-Perron pour voir si les séries étaient stationnaires à niveau ou en différence première. Ces tests ont comme hypothèse nulle de la présence de racine unitaire (non stationnarité) contre l'absence de racine unitaire (Stationnarité).

Les résultats de ces tests dont la méthodologie a été largement exposée au précédent chapitre sont synthétisés puis repris dans les tableaux suivants :

Tableau 3.1 – Test de stationnarité de Levin, Lin et Chu

Variables	LLC (Niveau)	LLC (1ère différence)	CONSTATS
$Demo' 1_t$	-11.3690*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$Demo' 2_t$	-2.08108** (0.0187)		Intégrée d'ordre 0
$G_t$	-3.6474*** (0.0001)		Intégrée d'ordre 0
$Y_t$	-12.4806*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$Pop_t$	-0.03949 (0.4842)	-1.75589** (0.0396)	Intégrée d'ordre 1
$Corr_t$	-1.46764* (0.0711)		Intégrée d'ordre 0
$I_t$	-8.64389*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$IDH_t$	-8.59302*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0

Source : Compilation de l'auteur.

Note : \*\*\* (\*\*) [\*] indiquent une signification à  $p < 0.01$  ( $p < 0.05$ ) [ $p < 0.10$ ].

Se basant sur la probabilité critique, le test de Levin, Lin and Chu (2002), suggère que les variables démocratie ( $Demo1_t$ ), taille du gouvernement ( $G_t$ ), logarithme du PIB par habitant ( $Y_t$ ), Investissements directs étrangers ( $I_t$ ) ainsi que l'indice de développement humain ( $IDH_t$ ) sont stationnaires à niveau au seuil de 1%. De plus, les variables démocratie ( $Demo2_t$ ) et population ( $Pop_t$ ) sont stationnaires au seuil de 5%. Respectivement à niveau et en différence première. Seule la variable corruption ( $Corr_t$ ) est stationnaire au seuil de 10%. Il ressort de ce tableau qu'avec le test de Levin, Lin et Chu, toutes nos variables sont stationnaires à niveau hormis la variable population qui est intégrée d'ordre 1. Nous rejetons donc l'hypothèse nulle  $H_0$  de non-stationnarité au profit de l'hypothèse alternative  $H_1$  de stationnarité.

Tableau 3.2 – Test de stationnarité de Im, Pesaran et Shin W-stat

Variabes	IPS (Niveau)	IPS (1ère différence)	CONSTATS
<i>Demo1<sub>t</sub></i>	-2.71960*** (0.0033)		Intégrée d'ordre 0
<i>Demo2<sub>t</sub></i>	1.62404 (0.9478)		Intégrée d'ordre 1
<i>G<sub>t</sub></i>	-2.60362*** (0.0046)		Intégrée d'ordre 0
<i>Y<sub>t</sub></i>	-6.31518*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
<i>Pop<sub>t</sub></i>	10.5865 (1.0000)	-1.53754* (0.0621)	Intégrée d'ordre 1
<i>Corr<sub>t</sub></i>	-1.81152** (0.0350)		Intégrée d'ordre 0
<i>I<sub>t</sub></i>	-8.02331*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
<i>IDH<sub>t</sub></i>	0.00610 (0.5024)		Intégrée d'ordre 1

Source : Compilation de l'auteur.

Note : \*\*\* (\*\*) [\*] indiquent une signification à  $p < 0.01$  ( $p < 0.05$ ) [ $p < 0.10$ ].

Compte tenu de la probabilité critique, le test de Im, Pesaran et Shin (2003) indique que les variables démocratie (*Demo1<sub>t</sub>*), taille du gouvernement (*G<sub>t</sub>*), logarithme du PIB par habitant (*Y<sub>t</sub>*), et les Investissements directs étrangers (*I<sub>t</sub>*) sont stationnaires à niveau au seuil de 1% et la corruption (*Corr<sub>t</sub>*) est stationnaire à niveau et au seuil de 5%. La variable population est intégrée d'ordre 1 au seuil de 10%. Les variables démocratie (*Demo2<sub>t</sub>*) et indice de développement humain (*IDH<sub>t</sub>*) ne sont pas stationnaires avec le test IPS. Nous rejetons l'hypothèse nulle  $H_0$  de non-stationnarité au profit de l'hypothèse alternative  $H_1$  de stationnarité pour toutes les variables de notre modèle hormis les deux variables précitées.

Tableau 3.3 – Test de stationnarité de type Fisher utilisant le test ADF

Variables	ADF (Niveau)	ADF (1ère différence)	CONSTATS
$Demo1_t$	96.4127*** (0.0020)		Intégrée d'ordre 0
$Demo2_t$	64.7819* (0.0780)		Intégrée d'ordre 0
$G_t$	111.213*** (0.0053)		Intégrée d'ordre 0
$Y_t$	165.976*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$Pop_t$	65.3895 (0.8022)	114.302*** (0.0030)	Intégrée d'ordre 1
$Corr_t$	107.405** (0.0103)		Intégrée d'ordre 0
$I_t$	198.186*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$IDH_t$	89.4081 (0.1394)		Intégrée d'ordre 1

Source : Compilation de l'auteur.

Note : \*\*\* (\*\*) [\*] indiquent une signification à  $p < 0.01$  ( $p < 0.05$ ) [ $p < 0.10$ ].

En référence à la probabilité critique, le test de stationnarité de type Fisher utilisant le test de ADF renseigne que les variables démocratie ( $Demo1_t$ ), taille du gouvernement ( $G_t$ ), logarithme du PIB par habitant ( $Y_t$ ), Investissements directs étrangers ( $I_t$ ) sont stationnaires à niveau au seuil de 1%. En parallèle, la variable population ( $Pop_t$ ) est intégrée d'ordre 1 au seuil de 1% en différence première. Les variables corruption ( $Corr_t$ ) et démocratie ( $Demo' 2_t$ ) sont intégrées d'ordre 0 respectivement au seuil de 5% et 10%. L'indice de développement humain ( $IDH_t$ ) s'est avéré non stationnaire à niveau avec le test de stationnarité de type Fisher utilisant le test ADF. Nous rejetons l'hypothèse nulle  $H_0$  pour toutes les variables de notre modèle au profit de l'hypothèse alternative, hormis pour l'indice de développement humain.

Tableau 3.4 – Test de stationnarité de Phillips-Perron

Variabes	PP (Niveau)	PP (1ère différence)	CONSTATS
$Demo1_t$	79.2250** (0.0489)		Intégrée d'ordre 0
$Demo2_t$	75.5264** (0.0113)		Intégrée d'ordre 0
$G_t$	118.524*** (0.0013)		Intégrée d'ordre 0
$Y_t$	235.762*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$Pop_t$	79.9835 (0.3551)	126.803*** (0.0002)	Intégrée d'ordre 1
$Corr_t$	114.519*** (0.0028)		Intégrée d'ordre 0
$I_t$	193.341*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0
$IDH_t$	158.916*** (0.0000)		Intégrée d'ordre 0

Source : Compilation de l'auteur.

Note : \*\*\* (\*\*) [\*] indiquent une signification à  $p < 0.01$  ( $p < 0.05$ ) [ $p < 0.10$ ].

Considérons la probabilité critique, le test de stationnarité de Phillips-Perron renseigne que les variables taille du gouvernement ( $G_t$ ), logarithme du PIB par habitant ( $Y_t$ ), Investissements directs étrangers ( $I_t$ ), corruption ( $Corr_t$ ), l'indice de développement humain ( $IDH_t$ ) et la population ( $Pop_t$ ) sont stationnaires à niveau au seuil de 1%. Hormis la population qui est intégrée d'ordre 1. De surcroît, les variables démocratie ( $Demo1_t$ ) et démocratie ( $Demo2_t$ ) sont intégrées d'ordre 0 au seuil de 5%. Nous rejetons l'hypothèse nulle  $H_0$  pour toutes les variables de notre modèle au profit de l'hypothèse alternative.

En définitive, disons que les différents tests sus évoqués dénotent que nos variables sont toutes intégrées d'ordre 0 hormis la population qui est intégrée d'ordre 1. Nous rejetons donc

l'hypothèse nulle  $H_0$  de non-stationnarité au profit de l'hypothèse alternative  $H_1$  de stationnarité. Toutefois, Nous considérons les résultats du test de Levin, Lin and Chu pour la suite de nos analyses.

### **3.1.2          Evaluation quantitative**

Après avoir présenté les résultats des différents tests de racine unitaire, nous présentons dans les tableaux suivants (3.5 et 3.6) les résultats des estimations de nos deux modèles d'analyse (Équations 2.1 et 2.2). Les résultats des estimations du modèle 1 (Équation 2.1) sont repris dans le tableau suivant :



Tableau 3.5 – Résultats de la régression avec l'indice de Freedom House

Variable dépendante	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
						-
$G_t$	-0,034*** (0,000)	-0,034*** (0,000)	-0,04*** (0,000)	-0,038*** (0,000)	-0,038*** (0,000)	0,04*** (0,000)
$Corr_t$		-0,77*** (0,001)	-0,71*** (0,002)	-0,74*** (0,002)	-0,75*** (0,002)	-0,73** (0,011)
$IDH_t$			4,92*** (0,000)	3,41* (0,081)	3,38* (0,085)	3,11 (0,222)
$Y_t$				0,58 (0,349)	0,58 (0,349)	0,72 (0,476)
$I_t$					-0,003 (0,894)	-0,001 (0,972)
$Pop_t$						-20,32 (0,861)
Constante	4,74*** (0,000)	4,28*** (0,000)	1,83*** (0,001)	0,78 (0,526)	0,78 (0,532)	0,79 (0,532)
$R^2$	0.885	0.892	0.894	0.894	0.894	0.892
Nombre des pays	38	38	38	38	38	38
Nombre d'observations	608	608	608	608	608	608
Prob(J-Stat)	0,797	0,934	0,943	0,973	0,934	0,854

Source : Compilation de l'auteur.

Note : \*\*\* (\*\*) [\*] indiquent une signification à  $p < 0.01$  ( $p < 0.05$ ) [ $p < 0.10$ ].

Les mécanismes de transmission issus de ce modèle seront exposés à la prochaine section.

Tableau 3.6 – Résultats de la régression avec l'indice de Polity IV

Variable dépendante	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
$G_t$	0,14*** (0,000)	0,15*** (0,000)	0,12*** (0,000)	0,128*** (0,000)	0,12*** (0,000)	0,153*** (0,004)
$Y_t$		-0,14 (0,845)	-4,08** (0,023)	-2,99*** (0,005)	-5,96** (0,019)	-9,06* (0,071)
$Corr_t$			14,99*** (0,002)	0,799 (0,889)	1,19 (0,234)	0,65 (0,647)
$IDH_t$				14,35*** (0,000)	23,37*** (0,004)	29,62** (0,019)
$I_t$					-0,14 (0,121)	-0,05 (0,763)
$Pop_t$						458,95 (0,861)
Constante	0,616** (0,039)	0,926 (0,674)	5,71 (0,169)	3,10 (0,423)	8,77* (0,086)	8,57 (0,173)
$R^2$	0,866	0,866	0,868	0,872	0,827	0,738
Nombre des pays	38	38	38	38	38	38
Nombre d'observations	608	608	608	608	608	608
Prob(J-Stat)	0,874	0,64	0,80	0,83	0,66	0,811

Source : Compilation de l'auteur.

Note : \*\*\* (\*\*) [\*] indiquent une signification à  $p < 0.01$  ( $p < 0.05$ ) [ $p < 0.10$ ].

## 3.2. Discussions sur les prédictions du modèle

### 3.2.1. Discussion avec l'indice de Freedom House

Il ressort du tableau 3.5 relatif au modèle 1, soit l'équation 2.1 ce qui suit :

Le tableau 3.5 reprend les estimations de six équations par la méthode de moment généralisé. À première vue, disons que nos spécifications sont globalement bonnes avec les  $R^2$  élevés et les probabilités associées aux statistiques J de Sargan-Hansen renseignent sur la bonté de l'instrumentalisation.

En effet, il ressort de nos estimations que la variable captant la taille du gouvernement agit significativement et de manière négative dans l'explication de la démocratie en Afrique dans toutes les spécifications. C'est-à-dire, l'augmentation des dépenses du gouvernement entraîne une diminution du niveau de la démocratie. La taille du gouvernement peut impacter négativement sur la démocratie car il existe un lien avéré entre le caractère autoritaire et confiscatoire d'un gouvernement et le déficit démocratique. Ainsi, la création et la distribution des portefeuilles cherchent à satisfaire les intérêts particuliers du clan au pouvoir au détriment de l'intérêt général.

L'analyse faite au paragraphe précédent peut être comparée à celle faite par certains auteurs, notamment Liet-Veaux (1961) ; Pomey (1972) qui, dans le domaine du service public estiment que le service public est créé dans le but de satisfaire l'intérêt général.

Cependant, Est qualifié service public « toute activité dont l'accomplissement doit être réglé, assuré et contrôlé par les gouvernants parce que l'accomplissement de cette activité est indispensable à la réalisation et au développement de l'interdépendance sociale et qu'elle est de telle nature qu'elle ne peut être assurée complètement que par l'intervention de la force gouvernante. » (Duguit, 1911, p.7). Et, suivant la conception large du service public, le gouvernement lui-même est service public et de ce fait, on ne saurait le concevoir dans un but autre que l'intérêt du peuple. Par le fait, la notion de service public est démocratique par essence, parce qu'elle ne dépend pas des modalités de représentation adoptées pour choisir les gouvernants et parce que les gouvernants sont étroitement limités par la mission de faire fonctionner le service public. « Tout acte des gouvernants est sans valeur quand il poursuit un but autre qu'un but de service public ». (Duguit, 1911, p.72).

Pourtant, on observe que des ministères sont scindés en morceau dans le but ultime de satisfaire les membres de toute la famille politique au pouvoir. Cela résulte également de la crise politique lorsque suite à un accord politique, les parties prenantes étant nombreuses, on multiplie les portefeuilles pour partager le pouvoir. Dans le contexte précis, il est difficile pour le peuple de choisir ses dirigeants compte tenu de la confiscation du pouvoir par une élite très nombreuse et parfois corrompue. Soit elle se maintiendra et pérennisera le pouvoir de façon peu démocratique pour en profiter seule au détriment du peuple, soit dans le contexte de la crise, s'engagera pour ne jamais la résoudre.

Que dire de la croissance économique ! Que la démocratie favorise ou non, la croissance dépend en partie de la nature des facteurs qui induisent une croissance sur le long terme. De la même façon, les effets de la croissance sur la démocratie sont liés à des éléments difficiles à déterminer concernant l'origine des attitudes et comportements politiques (Johnston, 2000, p.128). Notons que nous n'avons trouvé aucune liaison statistique significative entre la croissance économique et la démocratie. Ce résultat se rapporte à l'affirmation de Trebbi et al (2008) selon laquelle la démocratie devient une forte contrainte à la croissance économique pour les pays à faible niveau de développement. Plümper et Martin (2003) ont trouvé pour le cas de la Corée, Bolivie et l'Uruguay que les niveaux moyens de démocratie d'environ 6% augmentent le taux de croissance moyen de 0,20% par rapport à une autocratie pure et de 0,10% par rapport à une démocratie pure. Acemoglu et al (2014) trouvent que la démocratie a un effet positif significatif et robuste sur le PIB bien que pour notre cas l'inverse ne se vérifie pas. C'est-à-dire l'effet de la croissance économique sur la démocratie.

Pour ce qui est de la corruption, notons de prime abord que si la littérature théorique offre une grille de lecture détaillée de situations corruptives spécifiques (passation d'un marché public, etc.), la littérature empirique est lacunaire (Lavallée et al ,2010, p.6). Signalons que la variable contrôle de corruption a été introduite à partir de la deuxième spécification et a un effet négativement significatif dans l'explication de la démocratie en Afrique. Cependant, il est sans ignoreré que plus il y a contrôle de corruption moins autocratique serait le régime (l'exemple du Maurice, Afrique du Sud, Botswana, Namibie et la Côte d'Ivoire dans notre échantillon) ce qui n'est pas le cas pour notre échantillon pris dans son ensemble.

Par ailleurs, en Afrique, un individu ne peut être victime de pratiques corruptives que s'il est en contact avec l'administration. Or, plusieurs arguments théoriques suggèrent que la corruption elle-même diminue l'utilisation des services publics (Lavallée et al, 2010, pp.7-8). Tel est le cas des autres pays de notre échantillon. Ces arguments viennent en appui du résultat trouvé et corrobore à celui trouvé par Johnston (2000) à la question de savoir quels sont les effets directs de la corruption sur les processus démocratiques, Johnston (2000, p.118) montre que la corruption a des répercussions extrêmement négatives sur la démocratie, plus particulièrement pour les pays en voie de démocratisation qui cherchent un moyen de briser le cercle infernal de la corruption et de l'absence de développement. En bref, plus la corruption bat son plein en Afrique, moins démocratiques seraient les régimes.

S'agissant du développement, la littérature postule si la démocratie améliore-t-elle la qualité de vie des citoyens ? Aucun consensus ne semble être trouvé jusque-là. Deux avis s'opposent à ce sujet. D'une part, les chercheurs (Boix, 2001 ; Brown et Hunter, 2004 ; Dreze et Sen, 1989 ; Ghobarah et al, 2004 ; Lake et Baum, 2001 ; Lenski, 1966 ; Lipset, 1959 ; Meltzer et Richard, 1981 ; Muller, 1988) ont adopté le consensus selon lequel la démocratie améliore le développement humain. La logique de cette argumentation repose sur une grande partie que la participation populaire des citoyens au gouvernement y compris les très pauvres devrait par conséquent, amener le gouvernement à être plus responsable de leurs intérêts et d'autre part, les chercheurs (Gauri et Khaleghian, 2002 ; McGuire, 2004 ; Ross, 2006 ; Shandra et al, 2004) estiment au contraire qu'il n'existe pas de relation entre la démocratie et le développement humain. Les auteurs s'appuient sur les améliorations les plus spectaculaires du développement humain au cours du précédent siècle qui se sont déroulées sous les auspices d'un régime autoritaire (l'exemple des pays d'Asie de l'Est et dans les pays communistes), comparer aux pays d'Afrique Subsaharienne, les latino-américains, l'Inde etc.

En ce qui nous concerne, nous essayons de postuler si le développement humain améliore-t-il la démocratie et, la variable mesurant le développement humain intervient à partir de la troisième spécification et, est positivement significatif dans l'explication de la démocratie en Afrique de la troisième spécification jusqu'à la cinquième. Le développement contribue positivement dans l'explication de la démocratie en Afrique. Ce résultat se justifie par le fait que plus les conditions de vie s'améliorent (bonne est perçue la démocratie), moins la population s'intéresse à la politique et ça donne plus de chance au régime de s'éterniser. Notons

que cet argument demeure subjectif, comparer à la vieille démocratie américaine voire française. Cette conclusion vient soutenir l'avis selon lequel « dans les démocraties avancées, il a été démontré que les électeurs considèrent le Président de la République comme le principal responsable des résultats de la politique macroéconomique et pensent que les parlementaires sont plutôt comptables de la politique de redistribution sociale. Ainsi, le Président de la République est-il jugé et réélu (ou non) en fonction des indicateurs macroéconomiques » (Alesina et Rosenthal, 1995).

In fine, quant à la variable population, nous sommes partis de l'hypothèse que la population active est en même de contraindre un dictateur à quitter le pouvoir (l'exemple du printemps arabe et tant d'autres révolutions), mais le résultat économétrique ne révèle pas de lien significatif entre la population et la démocratie en Afrique.

### **3.2.2. Discussion avec l'indice de Polity IV**

Pour ce qui est de l'analyse de la robustesse des résultats, il sied de prime abord de signaler que le tableau 3.6 présente les résultats de nos estimations (modèle 2 soit équation 2.2) avec un autre indice de démocratie à savoir, la variable de démocratie produite par polity IV dont les détails ont été exposés précédemment.

Tout comme pour le modèle 1, les spécifications sont globalement bonnes avec les  $R^2$  élevés et les probabilités associées aux statistiques J de Sargan-Hansen renseignent sur la bonté de l'instrumentalisation.

En effet, disons que si avec l'indice de Freedom House dont la plus grande valeur était attribuée au régime autocratique il n'en est pas de même avec polity 2 où la valeur la plus élevée de l'échelle est attribuée aux régimes démocratiques.

Cependant, les résultats de nos estimations ne corroborent pas forcément dans la mesure où pour l'indice de démocratie de polity IV, la variable captant la taille du gouvernement reste significative, mais devient positive dans l'explication de la démocratie (Table 3.6) c'est-à-dire, l'augmentation des dépenses du gouvernement entraîne une amélioration du niveau de la démocratie. La nature de ce lien pourrait s'expliquer par la prise en charge des différents

pouvoirs (Législatif, exécutif et judiciaire, traditionnellement considéré par les libéraux comme la meilleure garantie contre l'abus de pouvoir).

L'organisation des élections augmente les dépenses des administrations publiques dans l'espoir que le peuple se tâchera de choisir leur guide. L'argent est donc dépensé pour faire respecter la voix du peuple. De plus, l'argent dépensé contribue à la démocratie dans le sens que les États africains bénéficient souvent des aides extérieures qui les contraignent à respecter certains principes démocratiques pour espérer en bénéficier à l'avenir (cf. Accords de Cotonou). Épousons la conclusion de Plümper et Martin (2003) qui s'argue que plus un pays est démocratique, meilleure est la qualité des dépenses du gouvernement.

Pour ce qui est de la croissance économique, rappelons que dans notre tableau 3.5 cette variable n'était pas significative. Cependant, elle devient significative bien que négative avec l'indice de démocratie de polity IV. La variable est intervenue de la deuxième à la sixième spécification et n'a pas été significative que dans la deuxième spécification. Le résultat trouvé renseigne que la croissance économique est significativement négative dans l'explication de la démocratie en Afrique. C'est-à-dire, plus le revenu par habitant augmente, moins les individus s'intéressent à la politique et le régime se pérennise. Cet avis est relatif, comparer à la vieille démocratie américaine ou française où malgré les niveaux élevés de prospérité économique, les peuples restent attachés à la politique. Le résultat trouvé se rapproche à une relation non linéaire (U) entre le niveau de la démocratie et la croissance économique trouvé par Barro (1996a et 1997) c'est-à-dire, l'accroissement de richesse tend à diminuer le niveau de la démocratie jusqu'aux valeurs médianes de l'échelle puis le niveau de démocratie s'améliore dépasser les valeurs médianes, et va à l'encontre de l'argument poussé par Johnston (2000, p.128) selon lequel l'un des arguments classiques en faveur d'un scénario de croissance-démocratie est dérivé de la « théorie de la modernisation » selon laquelle, en résumé, au fur et à mesure que les citoyens voient leurs besoins matériels de base satisfaits (ou, dans certains cas, en cas d'émergence d'une classe moyenne), ils adoptent plus volontiers des valeurs démocratiques.

S'agissant du contrôle de la corruption, contrairement aux résultats trouvés au tableau 3.5, les aboutissements actuels ne sont plus significatifs dans toutes les spécifications comme ce fut le cas pour la variable de Freedom House (significativement négatif). La variable s'est avérée

significative et positive lorsqu'elle fut introduite dans le modèle soit à la troisième spécification. C'est-à-dire, plus il y a contrôle de corruption plus démocratique serait le régime en Afrique. En ce qui concerne le développement, il sied de noter que tout comme dans le tableau 3.5 il intervient de manière positive et, est significatif dans les spécifications auxquelles il intervient. Ce qui veut dire que l'accroissement du niveau du développement humain accroît proportionnellement celui de la démocratie. Le résultat reste valable dans tous les deux tableaux (3.5 et 3.6) et renvoie à étudier de près le lien qu'il y a entre le développement humain et la démocratie en Afrique.

In fine, tout comme au premier modèle, les IDE et la population demeurent non significatifs dans l'explication de la démocratie.

### **3.3. Recommandations des politiques**

Au regard des résultats auxquels est abouti notre modeste travail, il est impérieux de formuler les recommandations suivantes :

- Réduire la taille du gouvernement des pays africains afin d'anticiper les pressions sur les dépenses publiques ;
- Dans le contexte de crise, limiter la création des portefeuilles dont le but est autre que la satisfaction de l'intérêt général mais plutôt à celui des sujets et fidèles du chef. Car cette pratique pourrait être génératrice de l'effet négatif de la taille du gouvernement sur la démocratie ;
- Le gouvernement doit, au plus haut niveau, montrer sa volonté politique de lutter contre la corruption et son engagement à mettre en œuvre des réformes de gouvernance en prenant des mesures concrètes. Ces actions enverront le message clair que la corruption n'est plus tolérée et qu'aucun individu corrompu à tout niveau de l'appareil étatique ne bénéficiera de l'impunité. Les États africains devraient donc assurer la transparence et redevabilité dans l'exécution de leurs fonctions, rendant compte de leurs actions auprès des dirigés ;
- Dans le cadre du cycle politico-économique calqué sur le calendrier électoral, il est impérieux d'emmener les électeurs à considérer le Président de la République comme le principal responsable des résultats de la politique macroéconomique et les parlementaires comme comptables de la politique de redistribution sociale afin que les élections quittent la sphère appartenance tribale (pour éviter les différents contentieux



qui en résultent généralement en Afrique) au profit des résultats macroéconomiques tel qu'il en est le cas dans les pays occidentaux voire dans les démocraties avancées;

- Veiller à la conduite du cycle politico-économique qui pousse les gouvernants à augmenter les dépenses publiques pour relancer l'économie afin de solliciter les voix du peuple au mépris du respect des équilibres macroéconomiques ;
- Établir un équilibre politique c'est-à-dire, arriver à une situation dans laquelle une majorité plus ou moins importante de citoyens se déclarent satisfaits des gouvernants ; leur pouvoir n'étant pas contesté, ces derniers ne se sentent pas contraints, en régime démocratique, de changer de politique, notamment de politique économique ;
- Promouvoir le recul de la pauvreté, l'accès à la santé, à l'éducation, à l'emploi et à la justice pour tous sont indispensables pour renforcer la démocratie ;
- Élaborer et mettre en œuvre une stratégie de communication en vue d'informer la population, régulièrement et honnêtement, sur les projets entrepris et les résultats obtenus. Cela devrait permettre au gouvernement de mobiliser le public et de gérer ses attentes.

Les propositions faites ci-haut seraient fournies par plusieurs chercheurs et observateurs. Certaines d'entre elles s'appliquent partiellement et dont l'effort de poursuite ou de parachèvement est impérieux. Ces propositions sont d'une très grande importance. Elles doivent cependant être considérées sous la lumière d'une idée qui, actuellement, ne fera pas l'unanimité, mais elles peuvent être salvatrices pour l'Afrique.

### **Conclusion du troisième chapitre**

Ce dernier chapitre de notre travail s'est accosté sur les résultats, discussions et recommandations assorties de notre étude portant sur la démocratie et taille du gouvernement en Afrique.

La première section présente les résultats de différents tests de stationnarité pris en compte dans notre travail et dont la conclusion est le rejet de l'hypothèse nulle  $H_0$  de non-stationnarité au profit de l'hypothèse alternative  $H_1$  de stationnarité ainsi que les résultats issus de nos modèles d'analyse.

La deuxième section s'est tâchée de discuter largement des mécanismes de transmission issus des résultats de nos modèles.

In fine, la troisième section s'est proposée de formuler quelques recommandations des politiques. Ainsi, nous passons à la conclusion de notre modeste travail.

## CONCLUSION

Ce serait témérité fautive d'estimer clore cette étude sur toutes ses facettes, il est plutôt question de retracer laconiquement le cheminement qu'a pris ce travail afin de dégager une somme susceptible d'un approfondissement ultérieur. Nous rappelons que ce n'est pas qu'une simple communication d'informations rassemblées, fussent-elles présentées en ordre. Elle est plutôt la démonstration d'une thèse partant des données disponibles. Pour prouver la validité de cette idée à laquelle elle se veut accorder le statut de vérité scientifique, nous avons eu de prime abord à présenter une introduction qui expose l'état de la question, pose la problématique, émet une hypothèse, identifie les méthodes et techniques d'approches, justifie le choix du sujet et en dégage l'intérêt, détermine la délimitation du sujet puis avance une annonce sommaire du plan.

Tout au long de notre travail portant sur la démocratie et taille du gouvernement en Afrique, nous avons gravité autour de trois chapitres dont le premier a éclairé nos lanternes sur la démocratie et taille du gouvernement : Théorie et Mesure (1), avant de bondir sur les données, modèle et méthodologie (2). Enfin, le troisième chapitre a porté sur appréciations critiques et Perspectives (3).

En démontrant au départ les antipodes de raisonnement de différents courants de la pensée économique sur la démocratie et le rôle de l'État pour comprendre la taille du gouvernement, deux questions majeures avaient été soulevées : (i) Quel est l'effet de la taille du gouvernement sur la démocratie ? et (ii) Quel est l'effet du développement sur la démocratie ?

À cet effet, deux hypothèses ont été émises, à savoir : (i) La taille du gouvernement aurait un effet négatif sur la démocratie dans la mesure où le gouvernement pris comme un service public aurait autre vocation que la satisfaction de l'intérêt général ; et (ii) Le développement humain contribuerait à l'explication de la démocratie c'est-à-dire, plus les conditions de vie s'améliorent sensiblement (bonne est perçue la démocratie), moins la population s'intéresse à la politique.

Pour répondre à notre problématique, nous avons considéré un ensemble de données sur 38 pays africains couvrant la période 2003-2018. L'indice de Freedom House (La moyenne des indices de droits politiques et liberté civile) et les dépenses de consommation finale des

administrations publiques en pourcentage du PIB ont été utilisés pour mesurer respectivement la démocratie et la taille du gouvernement. Par ailleurs, pour le contrôle de robustesse, nous avons utilisé l'indice de démocratie de Polity IV et les dépenses de consommation finale des administrations publiques en pourcentage du PIB. Contrairement aux études empiriques existantes, notre travail tient explicitement compte du problème d'endogénéité susceptible d'être engendré par le biais de causalité inverse.

En réponse à notre première question, les résultats d'estimations prédisent, d'une part, une relation négative et statistiquement significative entre la démocratie et la taille du gouvernement (Modèle 1 ; cfr. Equation.2.1 dont les résultats sont repris au tableau 3.5) et, d'autre part, un impact positif et statistiquement significatif entre la démocratie et la taille du gouvernement (Modèle 2 ; cfr. Equation.2.2 dont les résultats sont repris au tableau 3.6).

Les mécanismes de transmission dénotent pour le modèle 1, l'existence d'un effet négatif de la taille du gouvernement sur la démocratie. En effet, soutenons-nous en réponse à la première question posée que la taille du gouvernement peut impacter négativement sur la démocratie car, il est appréciable que plus le gouvernement est autoritaire plus le pouvoir est confisqué par des moyens moins démocratiques. Les portefeuilles sont donc créés non dans l'optique de satisfaire à l'intérêt général mais plutôt à celui des sujets et fidèles du chef. De ce fait, nous observons la scission des ministères dans le but ultime de satisfaire les membres de toute la famille politique au pouvoir.

Pour le contrôle de robustesse (modèle 2) le résultat trouvé ne corrobore pas dans la mesure où avec l'indice de démocratie de polity IV, la variable captant la taille du gouvernement reste significative, mais devient positive dans l'explication de la démocratie c'est-à-dire, l'augmentation des dépenses du gouvernement entraîne une amélioration du niveau de la démocratie. La nature de ce lien pourrait s'expliquer par la prise en charge des différents pouvoirs (Législatif, exécutif et judiciaire, traditionnellement considéré par les libéraux comme la meilleure garantie contre l'abus de pouvoir). De manière générique, les résultats de nos analyses contribuent à la littérature en offrant un éclairage novateur concernant le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement.

Au regard de ce résultat, il y a lieu d'affirmer nos prédictions de départ à 50%.

Pour ce qui est de la deuxième question, les résultats d'estimations prédisent un effet positif et significatif du développement sur la démocratie. C'est-à-dire l'accroissement du niveau du développement humain accroît proportionnellement celui de la démocratie. Ce résultat reste valable même pour le modèle 2. Nous affirmons notre seconde hypothèse avec beaucoup de réserve étant donné que ce mécanisme de transmission n'est pas totalement valable pour le cas des pays africains et renvoie à étudier de près le lien entre le développement humain et la démocratie en Afrique.

Le présent travail peut être amélioré ou prolongé dans plusieurs directions de recherche. Nous comptons emprunter dans le futur les directions suivantes : (i) Prendre en compte l'influence coloniale ainsi que les différences entre les pays d'Afrique du nord et d'Afrique subsaharienne; (ii) Transformer les deux indices (Freedom House et Polity IV) afin qu'ils se situent entre 0 et 1, 1 correspondant à l'ensemble des institutions les plus démocratiques (Barro, 1999; Acemoglu et Robinson, 2006). et, (iii) Une autre direction intéressante serait celle d'utiliser un indicateur de la taille du gouvernement autre que les dépenses de consommation finale des administrations publiques en pourcentage du PIB pour l'analyse de la robustesse. Cependant, nous envisageons de prendre en compte le nombre des ministres tel que Tsasa et Lokota (2012) l'ont fait. Bien que dans la littérature, le ratio des dépenses publiques ou des impôts au PIB ou à la population résidente et l'emploi total dans le secteur public sont aussi utilisés. Ces divers indicateurs ne transmettent pas la même information. D'où, le besoin de comparaison internationale ou régionale.

Par ailleurs, dans un contexte africain, laminé par la pauvreté, étudier la taille de du gouvernement et performance économique serait nécessaire pour comprendre, par exemple, le lien entre l'impôt et le bien-être de la population. D'autres analyses peuvent aussi approfondir le lien entre la taille du gouvernement et le marché noir ou la corruption afin d'épingler les obstacles majeurs à l'appropriation du projet étatique en Afrique.

In fine, notons que malgré toute l'attention portée à ce type de régime politique, la démocratie n'est pas un remède universel. La Banque mondiale explique que : « la démocratie à la fois représentative et participative est bonne en soi. Mais les processus politiques démocratiques à eux seuls ne sont pas suffisants pour garantir que la réduction de la pauvreté comptée parmi les priorités dans les effort d'une société ».

## BIBLIOGRAPHIE

### Ouvrages

- [1] ACEMOGLU, D., and ROBINSON, J. A. (2006). *Economic Origins of Dictatorship and Democracy*. Cambridge University Press. 433p.
- [2] ALESINA, A and H. ROSENTHAL. (1995). *Partisan Politics, Divided Government and the Economy*, Cambridge: Cambridge University Press, 298p.
- [3] ALVAREZ, M., J. A, CHEIBUB., F. LIMONGI and A. PRZEWORSKI. (1999). *ACLP Political and Economic: Database Codebook*, December.
- [4] ARISTOTE, 4e siècle av. J.-C, *La politique*.
- [5] AUBERGER, J. (1996). *Le Monde gréco-romain*. Boréal, Montréal. 128p.
- [6] BARRO, J. R. (1997). *The Determinants of Economic Growth: Across Country Empirical Study*, Cambridge, MA: MIT Press, 145p.
- [7] BASLÉ, M. (1991). *Quelques Économistes allemands : de « l'État commercial fermé » (1800) à « l'économie sociale de marché » (1950-1990)*. La Garenne-Colombes, Éditions de l'espace européen, 153p.
- [8] CAPUL, J-Y et GARNIER, O. (2015). *Dictionnaire d'économie et de sciences sociales*, Hatier, Paris, 696p.
- [9] DE SAINT MOULIN, L, KINKELA NSABI, J-M, PALUKU SYAYIPUMA, N et TSHIMANGA-MUKUBAYI, E. (2003). *La perception de la démocratie et de l'État de droit en R.D.C.*, Cepas, Kinshasa, 126p.
- [10] DE TOCQUEVILLE, A. (2008). *De la démocratie en Amérique*, Tome 1, Gallimard, Paris, 631p.
- [11] DREZE, J and A. SEN. (1989). *Hunger and Public Action*, Oxford: Clarendon Press, 373p.
- [12] DUGUIT, L. (1911). *Manuel de droit constitutionnel*, Fontemoing, 2ème éd.
- [13] DUVERGER, M. (1984). *Finances Publiques*, PUF, Paris.
- [14] EDELSTEIN, M. (2014). *La Révolution française et la naissance de la démocratie électorale*, Presses Universitaires de Rennes, 599p.
- [15] ELA, J-M. (1990). *Quand l'État pénètre en brousse... Les ripostes paysannes à la crise*, Karthala, Paris, 268p.
- [16] GALENSON, W. (1959). *Introduction to Galen-son, W, Labor and Economic Development*, New York: Wiley, 304p.

- [17] GASTIL, R. D. (1978). *Freedom in the World: Political and Civil Liberties*, Freedom House, New York, 335p.
- [18] GONIDEC, P-F. (1997). *Les Systèmes Politiques Africains, les nouvelles démocraties*, 3e édition, Paris, 242p.
- [19] HOBBS, T. (1651). *Leviathan*, Dutton, New York.
- [20] HOLEINDRE, J-V et BENOIT, R. (2010). *La Démocratie. Histoire, théories, pratiques, sciences humaines (synthèse)*, Auxerre, 354p.
- [21] HUNT, E.K., and M. LAUTZENHEISER. (2011). *History of Economic Thought : A Critical Perspective*. Troisième édition, M.E. Sharpe, New York, 608p.
- [22] HUNTINGTON, S. P and J. I. DOMINGUEZ. (1975). *Political Development*, In Fred I. Greenstein, and Nelson W. Polsby, Handbook of Political Science, Vol.3, Macropolitical theory, Reading, MA: Addison-Wesley, 114p.
- [23] HUNTINGTON, S. P. (1968). *Political Order in Changing Societies*, New Haven: Yale University Press.
- [24] KEYNES, J.M. (1936). *The General Theory of Employment, interest, and money*, New York: Cambridge University Press, 407p.
- [25] LENSKI, G. (1966). *Power and Privilege: A Theory of Social Stratification*, Chapel Hill: University of North Carolina Press, 495p.
- [26] LIPSET S.M. (1963). *L'homme et la politique*, Edition du seuil, Paris, 464p.
- [27] LOCKE, J. (1690). *Traité du gouvernement civil*, Flammarion, Paris.
- [28] LUNGUNGU, K. T et MULOPO, K. A. (2017). *Démocratie et limitation des mandats en Afrique. Combat pour la démocratie...Combattons le bon combat*, Médiaspaul, Kinshasa, 270p.
- [29] MACHIAVEL, N. (1531). *Discours sur la première décade de Tite-Live*, 599p.
- [30] MONTESQUIEU. (1874). *De l'Esprit des lois*, Garnier frères, Paris.
- [31] MOSSE, C. (1971). *Histoire d'une démocratie : Athènes. Des origines à la conquête macédonienne*, Seuil, Paris, 188p.
- [32] MUELLER C.D, FACCHINI F, FOUCAULT M, ABEL F, RAUL M-B et MELKI M. (2010). *Choix Publics. Analyse économique des décisions publiques*, De Boeck, Bruxelles, 889p.
- [33] NORTH, D. C. (1990). *Institutions, Institutional Change and Economic Performance*, Cambridge, U.K.: Cambridge University Press, 164p.
- [34] PLATON, *République*, Garnier-Flammarion.

- [35] PRZEWORSKI, A., M. ALVAREZ., J. A. CHEIBUB and F. LIMONGI. (2000). *Democracy and Development: Political Institutions and Material Well-Being in the World: 1950–1990*, New York: Cambridge University Press, 340p.
- [36] ROB, BUIJTENHUIJS et ELLY, RIJNIERSE. (1993). *Démocratie en Afrique au sud du Sahara (1989-1992) : un aperçu de la littérature*, Centre d’Études Africaines (Research Reports ;52).
- [37] ROSANVALLON, P. (1981). *La crise de l’État-providence*, Seuil, Paris, 183p.
- [38] SCHUMPETER, J. (1942). *Capitalisme, socialisme et démocratie*, Les classiques des sciences sociales, Québec, 431p.
- [39] SMITH, A. (1937). *The Wealth of Nations*, New York: Modern Library.
- [40] STIGLITZ, J.E. (2012). *The Price of Inequality*, W.W. Norton, New-York, 560p.
- [41] STIGLITZ, J.E., J.-D. LAFAY et J.K. ROSENGARD. (2018). *Économie du secteur public*, De Boeck, Bruxelles, 1088p.
- [42] SUMATA, C. (2014). *La gestion macroéconomique de la République démocratique du Congo durant et après la Transition démocratique*, L’Harmattan, Paris, 264p.
- [43] VEDDER K. R and L. E. GALLAWAY. (1998). *Government Size and Economic Growth*, Joint Economic Committee, December. <http://www.house.gov/jec/>.
- [44] ZWARTHOED, D. (2009). *Comprendre la pauvreté : John Rawls, Amartya Sen*, Presses Universitaires de France, Paris, 160p.

#### Articles

- [45] Acemoglu, Daron, Simon Johnson, James A. Robinson, and Pierre Yared. (2004). “From Education to Democracy”, *typescript*, MIT.
- [46] Acemoglu, Daron, Simon Johnson, James A. Robinson, and Pierre Yared. (2005). “Income and Democracy”, *National Bureau of Economic Research*, NBER Working Paper: No.11205.
- [47] Acemoglu, Daron, Simon Johnson, James A. Robinson, and Pierre Yared. (2008). “Income and Democracy”, *American Economic Review*, Vol.98, No.3, pp.808–842.
- [48] Acemoglu, Daron, Suresh Naidu, Pascual Restrepo and James A. Robinson. (2013). “Democracy, Redistribution and Inequality”, *NBER Working Paper* No. 19746.



- [49] Acemoglu, Daron, Suresh Naidu, Pascual Restrepo and James A. Robinson. (2014). “Democracy Does Cause Growth”, *Center for Development Economics and Policy*, No.22, March.
- [50] Acemoglu, Daron, Suresh Naidu, Pascual Restrepo and James A. Robinson. (2015). “Democracy, Redistribution, and Inequality”, *Handbook of Income Distribution*, Vol.2, pp.1885-1966.
- [51] Acemoglu, Daron, Suresh Naidu, Pascual Restrepo, and James A. Robinson. (2019). “Democracy Does Cause Growth”, *Journal of Political Economy*, Vol.127, No.1, pp.47-100. <http://economics.mit.edu/files/16686>.
- [52] Acemoglu, Daron. (2008). “Oligarchic vs. Democratic Societies”, *Journal of the European Economic Association*, Vol.6, No.1, pp.1–44.
- [53] Aidt, Toke S. and Peter S. Jensen. (2013). “Democratization and the size of government: evidence from the long 19th century”, *Public Choice*, vol.157, no.3/4, Special Issue: Essays in Honor of Martin Paldam, 511542, December.
- [54] Alvarez, Mike, José Antonio Cheibub, Fernando Limongi and Adam Przeworski. (1996). “Classifying Political Regimes”, *Studies in Comparative International Development*, Vol.31, pp.3-36.
- [55] Andrews, W.K Donald. (1991). “Heteroskedasticity and autocorrelation consistent covariance matrix estimation”, *Econometrica*, vol.59, pp. 817–858.
- [56] Anyang’Nyong’o, Peter. (1988). “Instabilité politique et perspectives de démocratie en Afrique”, *Politique étrangère*, Vol.53, No.3, pp.589-601, Automne.
- [57] Barro J. Robert. (1996a). “Democracy and growth”, *Journal of Economic Growth*, Vol.1, pp.1-27.
- [58] Barro J. Robert. (1999). “Determinants of Democracy”, *Journal of Political Economy*, Vol.107, No.6, pp. S158-S183.
- [59] Boix, Carles. (2001). “Democracy, Development and the Public Sector”, *American Journal of Political Science*, Vol. 45, pp. 1– 17, January.
- [60] Bouhdiba, Sofiane. (2014). “Inequities and Democracy: The case of post revolution Tunisia”, *International Development Economics Associates*, pp.8-21.
- [61] Breitung, Jorg. (2000). “The local power of some unit root tests for panel data”, in Badi H. Baltagi, Thomas B. Fomby, R. Carter Hill (eds), *Nonstationary Panels, Panel Cointegration, and Dynamic Panels*, *Advances in Econometrics*, Vol. 15, pp.161-177, December.

- [62] Brown S. David and Wendy Hunter. (2004). "Democracy and Human Capital Formation: Education Spending in Latin America, 1980–1997", *Comparative Political Studies*, Vol. 37, pp. 842–64, September.
- [63] Bunce, Valerie. (2003). "Rethinking recent democratization: Lessons from the Postcommunist Experience", *World Politics*, Vol.55, pp.167-92. January.
- [64] Campbell F. J David. (2008). "The basic concept for the democracy ranking of the quality of democracy. Austria: University of Klagenfurt", *Institute of Science Communication and Higher Education Research (WIHO)*, <http://www.uni-klu.ac.at/wiho>.
- [65] Campbell, Y. John., Pierre Perron. (1991). "Pitfalls and opportunities: what macroeconomists should know about unit roots", *National Bureau of Economic Research, Technical Working Paper Series*, Vol.55, No.100. April.
- [66] Carnegie J. Paul. (2009). "Democratization and Decentralization in PostSoeharto Indonesia: Understanding Transition Dynamics", *Pacific Affairs*, Vol.81, No.4, pp.515-525. Winter.
- [67] Choi, In. (2001). "Unit root tests for panel data", *Journal of International Money and Finance*, Vol. 20, No. 2, pp. 249-272, April.
- [68] Cohen, Daniel. (1984). "la fin du keynésianisme", *Esprit*, Vol.12, No.96, pp.125-136, décembre.
- [69] Cooray V. Arusha. (2009). "Government expenditure, government and economic growth", *Comparative Economic Studies*, Vol.51, No.3, pp.401-418.
- [70] Darracq, Vincent and Victor Magnani. (2011). "Les élections en Afrique : un mirage Démocratique ? ", *Politique étrangère*, vol.76, No.4, pp.839-850.
- [71] De Schweinitz, Karl Jr. (1959). "Industrialization, Labor Controls and Democracy", *Economic Development and Cultural Change*, Vol.7, pp. 385-404, July.
- [72] Diamond, Larry Jay. (2002). "Thinking About Hybrid regimes", *Journal of democracy*, Vol.13, No.2, pp.21-35. April.
- [73] Drury, A. Cooper., Kriekhaus, Jonathan and Lusztig Michael. (2006). "Corruption, democracy and economic growth", *International Political Science Review*, Vol.27, No.2, pp. 121-136.
- [74] Facchini, François and Melki Mickael. (2013). "Efficient government size: France in the century", *European Journal in Political*, Vol.31, pp.1-14.
- [75] Fève, Patrick. (2005). "Voies de la modélisation macro-économétrique ?", *Revue française d'économie*, Vol.20, No.1, pp.147-179.

- [76] Funk, Patricia and Christina Gathmann. (2011). "Does Direct Democracy Reduce the Size of Government? New Evidence from Historical Data, 1890-2000", *The Economic Journal*, vol.121, no.557, 1252-1280, December.
- [77] Gandjon Fankem, Gislain Stéphane. (2017). "Régime Politique et Ouverture Commerciale", *Revue d'économie politique*, Vol.127, No.3, pp.423-454.
- [78] Gauri, Varun and Khaleghian, Peyvand. (2002). "Immunization in Developing Countries: Its Political and Organizational Determinants", *World Development*, Vol.30, No.12, pp.2109-2132.
- [79] Ghobarah, Hazem Adam, Paul Huth and Bruce Russett. (2004). "Comparative Public Health: The Political Economy of Human Misery and Well-Being", *International Studies Quarterly*, Vol.48, No.1, pp. 73–94.
- [80] Goujon, Michaël. (2008). "Démocratie et surévaluation du taux de change : le cas de Madagascar", *Revue d'économie du développement*, Vol. 16, No. 3, pp. 87-113.
- [81] Grażyna, Strnad. (2010). "The sixth republic under Roh Tae Woo: The genesis of south Korean democracy", *Polish political science*, Vol.39, pp.204-225.
- [82] Guartney, James, Lawson Robert and Holcombe Randall. (1998). "The size and functions of government and economic growth", *Joint Economic Committee*, April.
- [83] Gurr T. Robert, Jagers, Keith and Moore H. Will. (1990). "The Transformation of the Western State: The Growth of Democracy, Autocracy, and State Power since 1800", *Studies in Comparative International Development*, Vol.25, No.1, pp.73-108.
- [84] Gurr T. Robert. (1974). "Persistence and Change in Political Systems 1800-1971", *American Political Science Review*, Vol.68, No.4, pp. 1482-1504. December.
- [85] Hadri, Kaddour. (2000). "Testing for stationarity in heterogeneous panel data", *Econometrics Journal*, Vol. 3, No. 2, pp. 148-161, December.
- [86] Hall, A. (1990). "Testing for a Unit Root in Time Series with Pretest Data-based Model Selection", *North Carolina State University*, Working Paper.
- [87] Hansen, Lars Peter. (1982). "Large Sample Properties of Generalized Method of Moments Estimators", *Econometrica*, Vol.50, No. 4, pp. 1029 – 1054, July.
- [88] Höglström, John. (2013). "Does the Choice of Democracy Measure Matter? Comparisons between the Two Leading Democracy Indices, Freedom House and Polity IV", *Government and Opposition*, Vol.48, No.2, pp.201-221.
- [89] Im, Kyung So, M. Hashem Pesaran and Yongcheol Shin. (1997). "Testing for unit roots in heterogeneous panels", *University of Cambridge*. DAE Working Paper, No.9526, revised version.

- [90] Im, Kyung So, M. Hashem Pesaran and Yongcheol Shin. (2003). "Testing for unit roots in heterogeneous panels", *Journal of Econometrics*, Vol. 115, No. 1, pp. 53-74, July.
- [91] Johnston, Michael. (2000). "Corruption et Démocratie : Menaces pour le développement, possibilités de réforme", *Revue Tiers Monde*, Vol.41, No.161, pp.117-142.
- [92] Kotera, Go, Keisuke Okada and Sovannroeun Samreth. (2012). "Government size, democracy, and corruption: An empirical investigation", *Economic Modelling*, vol.29, no.6, 2340-2348, November.
- [93] Lake A. David and Matthew A. Baum. (2001). "the Invisible Hand of Democracy: Political Control and the Provision of Public Services", *Comparative Political Studies*, Vol.34, pp. 587–621, August.
- [94] Lancelot, Alain, Blandine Kriegel, Maurice Agulhon, J-P Chevenement, Patrick Devedjian, Nicole Catala et Alain-Gérard SLAMA. (1996). " République et Démocratie", *Revue des deux mondes*, pp.81-111, Octobre.
- [95] Lavallée, Emmanuelle, Mireille Razafindrakoto et François Roubaud. (2010). "Ce qui engendre la corruption : une analyse microéconomique sur données africaines", *Revue d'économie du développement*, Vol.18, No.3, pp.5-47.
- [96] Le Gall, Philippe. (2008). "Les modèles économiques : perspectives méthodologiques et historiques. Note critique sur How Economists Model the World into Numbers de Marcel Boumans", *Revue d'Histoire des Sciences Humaines*, Vol. 2, No. 19, pp. 211-221.
- [97] Le Masne, Pierre. (2020). "La rupture de Carl Menger avec l'économie classique", *L'Économie Politique*, Vol.2, No.14, pp.96-112.
- [98] Levin, Andrew, Chien-Fu Lin and Chia-Shang James Chu. (2002). "Unit root tests in panel data: asymptotic and finite-sample properties," *Journal of Econometrics*, Vol. 108, No. 1, pp. 1-24, May.
- [99] Liet-Veaux, Georges. (1961). "La théorie du service public, crise ou mythe ?", *Revue administrative*, Vol.14, No.81, pp.256-264.
- [100] Lipset, Seymour Martin. (1959). "Some Social Requisites of Democracy: Economic Development and Political Development", *American Political Science Review*, Vol.53, pp. 69–105, March.
- [101] Lynn, Karl Terry. (1990). "Dilemmas of Democratization in Latin America", *Comparative Politics*, Vol. 23, No. 1, pp. 1-21. October.
- [102] Maddala, G. S. and Shaowen Wu. (1999). "A Comparative Study of Unit Root Tests with Panel Data and a New Simple Test", *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, Vol. 61, No. S1, pp. 631-652, November.

- [103] Marshall G. Monty and Jagers Keith. (2011). "Polity IV Project: Political Regime Characteristics and Transitions, 1800-2010, Dataset Users' Manual", *Center for Global Policy School of Public Policy*, George Mason University, Arlington, VA, Données disponibles à: <http://www.cidcm.umd.edu/polity>.
- [104] Marshall G. Monty, Jagers Keith and Gurr R. Ted. (2010). "Polity IV Project: political regime characteristics and transitions, 1800-2010. Dataset Users' Manual", *Center for Systemic Peace*.
- [105] McFaul, Michael. (2002). "The fourth wave of democracy and dictatorship: Noncooperatives Transitions in the Postcommunist World", *World Politics*, Vol.54, pp.212-244.
- [106] McGuire W. James. (2004). "Democracy, Health Care, and Under- 5 Mortality: A Cross-National Study of Developing Countries", *Wesleyan University*. Unpublished manuscript.
- [107] Meltzer H. Allan and Scott F. Richard. (1981). "A Rational Theory of the Size of Government", *Journal of Political Economy*, Vol.89, No.5, pp.914–927.
- [108] Muller N Edward. (1988). "Democracy, Economic Development, and Income Inequality", *American Sociological Review*, Vol. 53, pp.50-68, February.
- [109] Plümper, Thomas and Christian W. Martin. (2003). "Democracy, government spending, and economic growth: A political-economic explanation of the Barro-effect", *Public Choice*, Vol.117, pp. 27–50.
- [110] POMEY, M. (1972). "Fondation et services publics", *La Revue administrative*, Vol.25, No.149, pp.471-478.
- [111] Qiao, Mo, Siying Ding and Yongzheng Liu. (2019). "Fiscal decentralization and government size: The role of democracy", *European Journal of Political Economy*, vol.59, 316-330, September.
- [112] Rosanvallon, Pierre. (1981). "Histoire des idées keynésiennes en France", *Revue française d'économie*, Vol.2, No.4, pp. 22-56.
- [113] Ross, Michael. (2006). "Is Democracy Good for the Poor?", *American Journal of Political Science*, Vol.50, pp. 860–874, October.
- [114] Rousseau, Jean-Jacques. (1762). "Du contrat social ou principe du droit politique", *Collections complètes des œuvres*, Genève, Vol.1, No.4, 17801789.
- [115] Samiei, Neda and Mohammed Reza Jalilvand. (2011). "The Political Participation and Government Size", *Canadian social science*, Vol.7, No.2, pp.224-235.

- [116] Sandalcilar, Riza Ali. (2013). "Democracy and Growth: Evidence from Transition Economies", *American International Journal of Contemporary Research*, Vol.3, No.1, pp.63-75. January.
- [117] Seymour M. Lipset. (1959). "Some social requisites of democracy: economic development and political legitimacy", *The American Political Science Review*, Vol.53, No.1, pp.69-105, March.
- [118] Seymour M. Lipset. (1994). "The Social Requisites of Democracy Revisited: 1993 Presidential Address", *American Sociological Review*, Vol. 59, No. 1, pp. 1-22. February.
- [119] Shanaka, Herath. (2012). "Size of government and economic growth: a nonlinear analysis", *Economic Annals*, Vol.62, No.194, pp.7-30. September.
- [120] Shandra M. John, Jenna Nobles, Bruce London and John B. Williamson. (2004). "Dependency, Democracy, and Infant Mortality: A Quantitative, Cross-National Analysis of Less Developed Countries", *Social Science and Medicine*, Vol.59, pp. 321–33, July.
- [121] Sheng-Tung, Chen and Chien-Chang, Lee. (2005). "Government size and economic growth in Taiwan: A threshold regression approach", *Journal of Policy Modeling*, Vol.27, pp.1051-1066.
- [122] Siddhartha Baviskar and Mary Fran T. Malone. (2004). "What Democracy Means to Citizens-and Why It Matters", *European Review of Latin American and Caribbean Studies*, Vol.76, April.
- [123] Sims A. Christopher. (1980). "Macroeconomics and reality", *Econometrica*, Vol. 48, No.1, pp. 1–48, January.
- [124] Trebbi, Francesco, Philippe Aghion and Alesina Alberto. (2008). "Electoral Rules and Minority Representation", *The Quarterly Journal of Economics*, pp.325-357, February.
- [125] Tsasa V. Jean-Paul, Kimbambu et Michel-Ange Lokota Ilondo. (2012). "Arbitrage Qualité de la gouvernance et taille du gouvernement en RDC. Application du test de Shapiro – Wilk et Calcul conjoint de coefficients de Bravais – Galton – Pearson et de Spearman", *Laboratoire d'Analyse – Recherche en Économie Quantitative*, Vol.3, No.008, pp.89-98.
- [126] Vanhanen, Tatu. (2000). "A New Dataset for measuring Democracy, 1810-1998", *Journal of Peace Research*, Vol.37, No.2, pp.251-261.
- [127] Vergara, Francisco. (2008). "Intervention et laisser-faire chez Turgot (Le rôle de l'État selon le droit naturel) ", *Cahier d'économie politique*, No.54, L'Harmattan, pp.149-169.
- [128] Yamamura, Eiji. (2011). "Decomposition of the effect of government size on growth", *Economics Letters*, Vol.112, No.2010, pp.230-232.

[129] Yi C, Yi L, Zhigang T and Peng W. (2013). “The Impact of Income on Democracy Revisited”, *Journal of Comparative Economics*, Vol.41, pp. 159-169.

#### Notes du Cours et Webographie

[130] Banque Mondiale. (2019). “World Development Indicator”.  
<http://www.databank.banquemondiale.org/data/databases> .

[131] Freedom House. (2018). Freedom in the World 2018: “The Arab Uprisings and Their Global Repercussions”.  
<http://www.freedomhouse.org/report/methodology-freedomworld2018>.

[132] Freedom House. (2018). <http://www.freedomhouse.org/report/methodologyfreedom-world-2018>.

[133] Freedom House. (2019). “Freedom in the World”.  
<http://www.freedomhouse.org/report/freedom-world-2018-tablecountry-scores>.

[134] OPANGA EKANGA, V. (2016-2017). “Méthodes de recherche en sciences sociales et initiation à la recherche scientifique”. *Support du cours*, UCC/ G2 FED.

[135] PNUD. (2019). “Human Development Data (1990-2018) ”. <http://hdr.undp.org/en/data>.

[136] Polity IV Project. (2010). “The Center for Systemic Peace”.  
<http://www.systemicpeace.org/polity/polity4.ht>.

[137] The Economist. (2018). “Democracy Index: Liberty and Justice for Some”.  
<http://www.economist.com/node/8908438?storyid=8908438:18.12.2019> .

[138] World Governance Indicators. (2019). <http://info.worldbank.org/governance/wgi/home>.

**ANNEXE**

Table 3.7 – Annexe 1 : Liste des pays sous examen

---

1. Afrique du Sud	20. Madagascar
2. Algérie	21. Malawi
3. Angola	22. Mali
4. Bénin	23. Maroc
5. Botswana	24. Maurice
6. Burkina-Faso	25. Mauritanie
7. Burundi	26. Mozambique
8. Cameroun	27. Namibie
9. Comores	28. Nigéria
10. Congo	29. Ouganda
11. Côte-d'Ivoire	30. RD. Congo
12. Égypte	31. République centrafricaine
13. Gabon	32. Rwanda
14. Gambie	33. Sénégal
15. Ghana	34. Tanzanie
16. Guinée	35. Tchad
17. Guinée Bissau	36. Togo
18. Kenya	37. Tunisie
19. Libéria	38. Zambie

---



## TABLE DES MATIÈRES

<b>EPIGRAPHE .....</b>	<b>i</b>
<b>DÉDICACE.....</b>	<b>ii</b>
<b>REMERCIEMENTS.....</b>	<b>iii</b>
<b>SIGLES ET ABRÉVIATIONS .....</b>	<b>iv</b>
<b>LISTE DES TABLEAUX .....</b>	<b>v</b>
<b>INTRODUCTION.....</b>	<b>1</b>
<b>0.1 État de la question .....</b>	<b>1</b>
<b>0.2 Problématique.....</b>	<b>3</b>
<b>0.3 Hypothèses.....</b>	<b>8</b>
<b>0.4 Méthodes et Techniques.....</b>	<b>8</b>
<b>0.4.1 Méthodes .....</b>	<b>8</b>
<b>0.4.2 Techniques .....</b>	<b>10</b>
<b>0.5 Choix et Intérêt du Sujet.....</b>	<b>10</b>
<b>0.6 Délimitation de l'étude .....</b>	<b>11</b>
<b>0.7 Subdivision du travail .....</b>	<b>11</b>
<b>CHAPITRE 1 : LA DÉMOCRATIE ET TAILLE DU GOUVERNEMENT.....</b>	<b>12</b>
<b>1.1. La démocratie : Théorie et Mesure.....</b>	<b>12</b>
<b>1.1.1. Définition de la démocratie.....</b>	<b>12</b>
<b>1.1.2. Démocratie : Théorie .....</b>	<b>13</b>
<b>1.1.3. Démocratie : Mesure.....</b>	<b>21</b>
<b>1.2. La taille du gouvernement : Théorie et Mesure.....</b>	<b>27</b>
<b>1.2.1. Esquisse définitionnelle.....</b>	<b>27</b>
<b>1.2.2. Taille du gouvernement : Théorie.....</b>	<b>28</b>
<b>1.2.3. Taille du gouvernement : Mesure .....</b>	<b>34</b>
<b>1.3. Revue de la littérature sur le lien entre la démocratie et la taille du gouvernement</b>	
36	
<b>Conclusion du premier chapitre .....</b>	<b>39</b>

<b>CHAPITRE 2 : DONNÉES, MODÈLE ET MÉTHODOLOGIE.....</b>	<b>40</b>
<b>2.1. Données : Source, Description et Statistiques.....</b>	<b>40</b>
<b>2.1.1. Sources et description des données .....</b>	<b>40</b>
<b>2.2. Modèle d'analyse .....</b>	<b>42</b>
<b>2.2.1. Bref aperçu de la modélisation en économie.....</b>	<b>42</b>
<b>2.2.2. Construction du modèle d'analyse et Justification du choix des variables.....</b>	<b>43</b>
<b>2.3. Méthodologie d'estimation .....</b>	<b>46</b>
<b>2.3.1. Justification de la méthode .....</b>	<b>46</b>
<b>2.3.2 Méthode d'estimation économétrique .....</b>	<b>53</b>
<b>CHAPITRE 3 : APPRÉCIATIONS CRITIQUES ET PERSPECTIVES .....</b>	<b>59</b>
<b>3.1. Résultats et validation d'estimation.....</b>	<b>59</b>
<b>3.1.1. Résultat de la stationnarité des variables.....</b>	<b>59</b>
<b>3.1.2 Évaluation quantitative.....</b>	<b>64</b>
<b>3.2. Discussions sur les prédictions du modèle.....</b>	<b>67</b>
<b>3.2.1. Discussion avec l'indice de Freedom House.....</b>	<b>67</b>
<b>3.2.2. Discussion avec l'indice de Polity IV .....</b>	<b>70</b>
<b>3.3. Recommandations des politiques .....</b>	<b>72</b>
<b>Conclusion du troisième chapitre .....</b>	<b>74</b>
<b>CONCLUSION.....</b>	<b>75</b>
<b>BIBLIOGRAPHIE .....</b>	<b>78</b>
Ouvrages.....	78
Articles .....	80
Notes du Cours et Webographie.....	87
<b>ANNEXE .....</b>	<b>88</b>