

Cote du document: EC 2020/109/W.P.4/Add.1
Ordre du jour: 5
Date: 22 mai 2020
Distribution: Publique
Original: Anglais

F



Investir dans les populations rurales

Observations du Bureau indépendant de l'évaluation du FIDA à propos des résultats des analyses de sensibilité concernant FIDA10 et des répercussions sur FIDA11

Note à l'intention des membres du Comité de l'évaluation

Responsables:

Questions techniques:

Fabrizio Felloni
Responsable par intérim
Bureau indépendant de l'évaluation du FIDA
téléphone: +39 06 5459 2361
courriel: f.felloni@ifad.org

Transmission des documents:

Deirdre Mc Grenra
Cheffe
Gouvernance institutionnelle et relations avec les États membres, SEC
téléphone: +39 06 5459 2374
courriel: gb@ifad.org

Comité de l'évaluation — Cent neuvième session
Rome, 19 juin 2020

Pour: **Examen**

I. Contexte et observations générales

1. En septembre 2019, le Bureau indépendant de l'évaluation du FIDA (IOE) a soumis au Comité de l'évaluation et au Conseil d'administration ses commentaires sur le Rapport d'évaluation de l'impact dans le cadre de FIDA10. La Division recherche et évaluation de l'impact du FIDA (RIA) a ensuite établi une analyse de sensibilité portant sur cette même opération.
2. Les présentes observations d'IOE visent à livrer un examen indépendant des analyses de sensibilité de la Division RIA, ainsi que des remarques constructives à son sujet pour appuyer les actions futures.
3. L'initiative relative à l'évaluation de l'impact est un nouvel élément utile du système d'auto-évaluation du FIDA. Les évaluations de l'impact peuvent être une source supplémentaire d'observations et d'informations sur la performance du portefeuille pour la direction et pour IOE. Elles peuvent contribuer à accroître le volume des connaissances sur la performance et les résultats et appuyer la préparation de nouvelles manières de concevoir les projets.
4. IOE prend note du fait que c'est la première fois qu'une institution financière internationale s'efforce de tirer des conclusions sur l'impact de son portefeuille à partir d'un échantillon de projets. Il s'agit là d'une opération difficile, non seulement en raison du calendrier d'exécution, mais aussi sur le plan de l'analyse. La méthode d'évaluation de l'impact a initialement été mise à l'essai dans le cadre de FIDA9, puis a été précisée et appliquée durant FIDA10. Le moment est venu de faire le bilan de cette expérience.
5. IOE applaudit les efforts déployés par le Département RIA pour procéder à une analyse de sensibilité et, notamment, appliquer la correction d'Heckman au modèle de sélection de l'échantillon. L'analyse de sensibilité décrit les types de données et d'informations disponibles lors du lancement de l'initiative relative à l'évaluation de l'impact. Elle utilise, pour l'essentiel, les valeurs des indicateurs de performance des projets disponibles en 2016. Ces valeurs sont calculées chaque année pour les rapports sur l'état d'avancement des projets, sur la base des constatations des missions de supervision.
6. IOE observe de manière générale que, lorsque les constatations des évaluations sont présentées dans le but de promouvoir la responsabilité, il est important de s'assurer: i) que ces constatations soient représentatives (c'est-à-dire qu'elles puissent être généralisées à l'ensemble de la population dont elles proviennent); ii) que les limites de leur représentativité, détectées avant ou après l'enquête sur l'impact, soient pleinement divulguées et soient expliquées.
7. Au vu de l'analyse de sensibilité et des données disponibles, IOE note de nouveau à quel point il apprécie cet exercice, mais exprime ses réserves quant à la généralisation des constatations formulées sur la base de l'échantillon de projets menés durant FIDA10 à l'intégralité du portefeuille de projets clôturés durant cette même période. Les principaux points sur lesquels il attire l'attention sont présentés ci-après:
 - i) le protocole de sélection des projets privilégie la représentativité régionale et thématique, mais ne comporte aucune procédure de randomisation (par exemple, tirage au sort) qui permettrait de neutraliser le biais pouvant être associé à une procédure d'échantillonnage dirigé;
 - ii) IOE sait que les ressources sont limitées; la petitesse de l'échantillon (19 projets pour FIDA10) remet toutefois en cause la représentativité des résultats au niveau des classes de performance des projets;
 - iii) les points faibles de la généralisation des constatations, et les mises en garde en ce domaine, auraient pu être exposés plus en détail dans le rapport initial.

II. Observations particulières

8. Comme indiqué dans les observations formulées par IOE en septembre 2019, l'échantillon de projets sélectionné pour l'évaluation de l'impact du FIDA présente une anomalie, car les notes attribuées à la plupart des critères d'évaluation sont sensiblement supérieures à celles d'autres projets achevés durant FIDA10. Ces disparités apparaissent aussi bien pour les notes figurant dans les rapports d'achèvement de projet (préparés par la direction du FIDA) que pour les notes des évaluations indépendantes effectuées au niveau des projets (préparées par IOE). Ce type de divergence ne devrait pas exister pour un échantillon représentatif du portefeuille dont les éléments sont répartis de manière équilibrée entre les classes de performance au niveau de l'exécution.
- i) En ce qui concerne les rapports d'achèvement de projet, le document d'analyse de la sensibilité préparé par la Division RIA (tableau 1, p. 12) confirme que les notes moyennes sont supérieures pour tous les critères des projets et que les écarts observés sont significatifs (valeur-p < 0,05) pour 10 des 14 critères considérés;
 - ii) en ce qui concerne les notes des évaluations indépendantes d'IOE, les notes moyennes des projets retenus pour l'évaluation de l'impact sont aussi supérieures de manière significative sur le plan statistique (valeur-p < 0,05) pour 11 des 14 critères: pertinence, efficacité, efficience, performance du projet, impact sur la pauvreté rurale, innovation, égalité des sexes, adaptation aux changements climatiques, performance du FIDA, performance des pouvoirs publics, résultat global du projet (tableau 1 de l'annexe I du présent document).
9. L'analyse de sensibilité aboutit à la conclusion que, toutes choses étant égales par ailleurs, l'impact pourrait avoir été surestimé de 2% pour la mobilité économique, de 15% pour l'accès au marché, de 10% pour la production et de 6% pour la résilience, mais que les résultats relatifs à la nutrition ne sont pas modifiés. Le fait que ces écarts soient, ou non, négligeables est question d'interprétation et il serait utile, dans tous les cas, de considérer les intervalles de confiance des estimations. Les écarts entre ces dernières s'inscrivent, dans de nombreux cas, dans un intervalle de confiance relativement large, qui peut atteindre 40% pour les estimations ajustées par la méthode d'Heckman.
10. Le document de l'analyse examine les écarts entre les notes établies à partir des valeurs indiquées pour les indicateurs dans les rapports sur l'état d'avancement des projets disponibles en 2016. Il est important de noter que les valeurs prises par ces indicateurs: i) fluctuent généralement durant le cycle du projet et peuvent ne pas systématiquement indiquer la performance et les résultats ultimes d'un projet; ii) ne sont pas assujetties à des examens et à des revues par les pairs dans la même mesure que les notes indiquées dans les rapports d'achèvement de projets ou dans les évaluations indépendantes.
11. L'analyse applique la méthode d'Heckman pour corriger le biais de sélection de l'échantillon. Il importe toutefois de noter ici que, comme expliqué dans les études consacrées à cette question¹, l'approche en deux étapes d'Heckman peut ne pas produire des estimations correctes lorsque les échantillons sont de taille limitée et qu'il existe une forte multicolinéarité entre la valeur estimée de l'indicateur figurant dans la première équation et la variable figurant dans le membre droit de la deuxième équation.
12. Le rapport sur l'analyse de sensibilité fait valoir que l'évaluation de l'impact pourrait avoir influencé la note de l'impact sur la pauvreté rurale. Il convient toutefois de souligner: i) que les projets sélectionnés pour l'évaluation de l'impact ont des notes moyennes supérieures de manière significative sur le plan statistique pour la

¹ Nawata, K. et Nagase N., 1996, *Estimation of Sample Selection Models*, *Econometric Review* 15, 387-400.

plupart des critères (et pas seulement pour l'impact sur la pauvreté rurale); ii) que dans plusieurs pays (comme le Brésil, Madagascar, le Mexique et São Tomé-et-Principe), l'évaluation de l'impact n'était pas disponible ou achevée au moment de la préparation du rapport d'achèvement de projet et de l'évaluation indépendante. Dans tous les cas, même en l'absence d'une évaluation de l'impact, des données sur l'impact au niveau des projets avaient été produites dans un grand nombre de cas par des enquêtes, par exemple dans le cadre du Système de gestion des résultats et de l'impact, ou d'autres enquêtes et études réalisées à la demande d'une unité de gestion du projet.

13. Il importe de ne pas accorder trop d'importance à la distinction effectuée dans le rapport entre les indicateurs "objectifs" et les indicateurs "subjectifs" comme les notes. Une grande partie du rapport sur l'analyse de sensibilité a été établie à partir des indicateurs de performance au niveau de l'exécution, qui sont des notes. Ces dernières sont couramment utilisées dans le cadre des auto-évaluations et des évaluations indépendantes. Les notes ne sont pas attribuées de manière arbitraire: elles sont établies à l'issue d'une analyse des données et d'une triangulation des observations et elles font l'objet d'un examen par les pairs en interne ainsi que d'un examen par des parties prenantes extérieures.

III. Conclusions et perspectives

14. IOE est pleinement conscient des problèmes pratiques et théoriques posés par l'établissement d'une stratégie d'échantillonnage robuste en l'absence d'indicateurs de performance *ex-ante* satisfaisants et pour des échantillons de taille limitée.
15. L'analyse de sensibilité apporte des éclaircissements sur les indicateurs de performance des projets qui étaient disponibles lors de la planification de l'initiative relative à l'évaluation de l'impact pour FIDA10. Il existe toutefois d'importants écarts entre les notes, d'une part, des différents projets sélectionnés et, d'autre part, des projets non sélectionnés, si l'on considère les auto-évaluations et les évaluations indépendantes réalisées après l'achèvement des projets. Les raisons de ces écarts *ex-post* n'ont toujours pas été expliquées. Il importe donc de formuler une mise en garde avant de généraliser les conclusions de l'évaluation de l'impact à l'intégralité du portefeuille du FIDA.
16. Pour pouvoir établir de robustes inférences sur l'impact de l'ensemble du portefeuille financé par le FIDA, il est important de veiller à ce que les conclusions soient représentatives et que des corrections aient été effectuées. Compte tenu des observations précédentes, il serait possible d'envisager, à l'avenir, les options ci-après:
 - i) une méthode d'échantillonnage aléatoire stratifié (comme le recours à un tirage au sort pour constituer l'échantillon de projet). Il serait dans ce cas possible de constituer une réserve au cas où il s'avérerait nécessaire de procéder au remplacement d'éléments de l'échantillon (par exemple en cas de situation d'urgence). Tout remplacement devrait alors être pleinement documenté;
 - ii) l'accroissement de la taille de l'échantillon, pour atteindre le degré de précision requis pour l'évaluation de l'impact et la variance escomptée de la distribution des principales caractéristiques de la population de projets;
 - iii) la pondération des impacts des projets dans le cadre des méta-analyses (sur la base, par exemple, des notes des rapports d'achèvement de projet ou de celles attribuées par IOE);
 - iv) la présentation d'informations sur les limites de la représentativité de l'échantillon.

17. Les observations d'IOE ne portent sur aucun autre aspect de l'évaluation de l'impact, tels que la robustesse des différentes évaluations d'impact et de la stratégie d'agrégation des constatations. Il serait possible d'envisager à l'avenir:
 - i) d'établir des intervalles de confiance pour les estimations des impacts;
 - ii) de revoir les hypothèses retenues dans le cadre des méta-analyses pour l'agrégation des constatations;
 - iii) d'expliquer les principaux aspects et limites de la méthode utilisée pour sélectionner les échantillons employés pour les évaluations des impacts des différents projets. L'examen de ces différents éléments serait d'une grande utilité non seulement pour le FIDA, mais aussi pour d'autres organisations qui pourraient souhaiter entreprendre ce type d'exercice.

Comparaison actualisée des notes des projets inclus dans l'échantillon utilisé pour l'évaluation de l'impact et des notes tirées des évaluations d'IOE au niveau des projets (pour FIDA10)

Tableau 1

Comparaison des notes moyennes d'IOE pour l'échantillon retenu pour l'évaluation de l'impact (19 projets) et des notes d'autres projets achevés durant FIDA10 (2016–2018) (88 projets)

Indicateur	Notes moyennes d'IOE (échantillon EI FIDA10)	Notes moyennes d'IOE (projets de FIDA10 sans EI)	Écart entre les notes moyennes d'IOE (FIDA10 avec EI et FIDA10 sans EI)	Valeur-p- du test-t des écarts entre les notes moyennes d'IOE (FIDA10 avec EI et FIDA10 sans EI)	Notations médianes d'IOE (échantillon EI pour FIDA10)	Notations médianes d'IOE (projets clôturés de FIDA10 sans EI)	Projets de FIDA 10 échantillon de projets EI pour lesquels la notation d'IOE est supérieure à la médiane des projets non EI (en pourcentage)
Pertinence	4,54546	4	0,545455	0,01127*	5	4	55
Efficacité	4,454545	3,852941	0,601604	0,00664**	4	4	45
Effizienz	4,18182	3,55882	0,622994	0,03239*	4	3,5	82
Durabilité	4,09091	3,70588	0,385027	0,192	4	4	36
Performance du projet	4,34546	3,77206	0,573396	0,00201**	4,5	4	82
Impact sur la pauvreté rurale	4,63636	3,91177	0,724599	0,00095**	5	4	64
Innovation	4,72727	4,14706	0,580214	0,03337*	5	4	64
Reproduction à plus grande échelle	4,27273	3,97059	0,302139	0,2548	4	4	36
Égalité des sexes et autonomisation des femmes	4,54546	3,91177	0,63369	0,02653*	4	4	45
Gestion de l'environnement et des ressources naturelles	4,27273	4,125	0,147727	0,5843	4	4	45
Adaptation aux changements climatiques	4,45455	3,92308	0,531468	0,0412*	5	4	55
Performance du FIDA	4,63636	4	0,636364	0,00314**	5	4	64
Performance des pouvoirs publics	4,54546	3,78125	0,764205	0,00725**	5	4	64
Résultat global du projet	4,54546	3,9375	0,607955	0,02214*	5	4	91

* Significatif au seuil de 5%.

** Significatif au seuil de 1%.

Source: Calculs effectués par IOE au moyen de la base de données du Rapport annuel sur les résultats et l'impact des opérations du FIDA (RARI).

Note: EI= évaluation indépendante.