

RECENSIONI E SEGNALAZIONI BIBLIOGRAFICHE

HEIJ C., DE BOER P., FRANSES P.H., KLOEK T., VAN DIJK H.K., *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*, 2004, Oxford University Press, pp. XXVI+787.

Il volume fornisce un'introduzione all'econometria moderna in modo semplice e attraverso esempi ma allo stesso tempo non trascurando il rigore matematico. Vengono discussi in dettaglio i metodi per la formulazione, la stima e la validazione dei modelli econometrici più rilevanti dal punto di vista applicativo. In particolare, i primi 5 capitoli forniscono un trattamento dei metodi più importanti e delle idee centrali che stanno alla base dell'econometria. Per quanto riguarda gli aspetti più teorici gli autori hanno scelto di concentrare l'attenzione sui metodi parametrici, mentre non sono trattati i metodi non parametrici o semi parametrici. Nel capitolo 6 e 7, invece, sono discusse in dettaglio due vaste aree di applicazione; la prima, trattata nel capitolo 6, riguarda i modelli per il comportamento economico individuale con esempi derivanti dal marketing e dalla microeconomia; la seconda area (capitolo 7) riguarda i modelli per le serie temporali con applicazioni alla finanza e alla macroeconomia. Infine, sono presenti due appendici dedicate ai richiami di algebra lineare e ai data set utilizzati nel libro. Si può affermare che il tratto saliente del presente volume sia l'enfasi data al legame fra teoria e applicazione, enfasi che si riflette nelle nutrite sezioni dedicate agli esercizi alla fine di ogni capitolo. Una grande attenzione è stata posta sugli aspetti didattici sia attraverso la guida alla lettura, sia attraverso il materiale presente sul sito dedicato che permette al lettore di riprodurre molte delle analisi di casi reali presentate.

Per le sue caratteristiche il testo può essere utilizzato sia per gli studenti delle lauree triennali sia per quelli delle lauree specialistiche o dei master. Inoltre, il volume si rivela come un manuale di facile e immediata consultazione per chiunque volesse applicare i metodi dell'econometria.

s.gm.

DOUCET, A., DE FREITAS, N., GORDON, N. Editors, *Sequential Monte Carlo Methods in Practice*, 2004, Springer, pp. 584+xx.

Il testo è una introduzione ai metodi di simulazione Monte Carlo sequenziali (*particle filters*) per il calcolo delle probabilità a posteriori in modelli bayesiani. La struttura è quella di una ingente raccolta di contributi articolata in tre parti: la

prima presenta gli aspetti teorici degli algoritmi Monte-Carlo sequenziali; la seconda illustra i metodi per valutare l'efficienza di detti algoritmi; la terza parte considera applicazioni a modelli economici e finanziari, reti neurali, analisi delle serie storiche, robotica, processi industriali di controllo e biologia delle popolazioni.

Le tre parti sono indipendenti e autocontenute per il lettore esperto che utilizzerà il libro come un riferimento, mentre un'introduzione al problema guiderà il lettore che voglia avvicinarsi al soggetto.

a.lu.

HENDRY, D.F., ERICSSON, N.L. Editors, *Understanding Economic Forecasts*, 2004, The Massachusetts Institute of Technology Press, pp. 207+xviii.

La raccolta di contributi curata da D.F. Hendry e N.L. Ericsson presenta il moderno punto di vista sulle previsioni economiche di eminenti studiosi tra cui Clive Granger, Denise Osborn, lo stesso David Hendry. Rilassando le ipotesi storiche di modello teorico rappresentativo e struttura economica omogenea su cui ha poggiato per anni la teoria delle previsioni economiche, è stato possibile sviluppare teorie e metodi che riconoscano la dinamicità dei sistemi economici e la propensione ai cambiamenti improvvisi. Il testo presenta tali sviluppi nell'ottica di fornire un quadro critico su come è pensata, formalizzata, valutata e applicata una previsione e quali sono i costi associati all'errore di previsione.

I contributi degli autori, che riguardano argomenti generici come le previsioni in condizioni di incertezza o i costi degli errori di previsioni e argomenti specifici quali il ciclo economico inglese o le previsioni della Banca di Inghilterra, sono completati da una introduzione e da un epilogo da parte degli autori. Il libro è piacevole e di ottimo livello e di certo interesserà chiunque si occupi di analisi di serie storiche, modelli economici e tecniche di previsione.

a.lu.

HUBER-CAROL, C., BALAKJISHNAN, N., NIKULIN, M.S., MESBAH, M. Editors, *Goodness-of-fit Tests and Model Validity*, 2004, Birkhauser, pp. 508+xxxiv.

Il testo è una raccolta di lavori che sono stati presentati alla *International Conference on Goodness-of-Fit Tests and Model Validity* che si è tenuta in onore di Karl Pearson e del suo articolo sul test di adattamento chi-quadrato. I trentasette articoli che vanno dai fondamenti del test chi-quadrato fino alle più recenti generalizzazioni costituiscono una rassegna aggiornata sui test di adattamento. Le otto parti riguardano: fondamenti e storia della teoria dei test di adattamento, test chi-quadrato, test di adattamento in modelli parametrici e in modelli di regressione, metodi grafici, accuratezza e applicazioni. Il volume è omogeneo anche se ciascun contributo appare come un articolo indipendente dagli altri, con i propri riferimenti bibliografici.

a.lu.

J.C. GOWER, G.B. DIJKSTERHUIS, *Procrustes problems*, Oxford University Press, Dordrecht, 2004, pp. XI+233.

La locuzione analisi di Procuste fa riferimento ad un corpus di metodi statistici il cui nome deriva dal personaggio della mitologia greca classica Procuste, un brigante che costringeva a sdraiarsi nel suo letto a forma di incudine scavata nella roccia i viandanti che si imbattevano in lui; quelli che risultavano corti rispetto alla lunghezza del letto venivano tirati a forza per le estremità, quelli che invece sporgevano venivano accorciati tramite amputazione.

L'obiettivo dei metodi statistici per l'analisi di Procuste, del tutto simile a quello del personaggio mitologico, è infatti adattare tra loro due o più matrici prefissate mediante opportune trasformazioni delle sue colonne, quali ad esempio traslazioni, rotazioni ortogonali od oblique. Le matrici poste a confronto possono contenere le coordinate individuate mediante metodi di scaling multidimensionale, i punteggi ottenuti da analisi dei fattori e/o più semplicemente un insieme di dati multivariati rilevati su un campione di unità.

Tali metodi rappresentano il tema trattato nel volume, che ne illustra in maniera chiara ed esauriente i fondamenti teorici nonché le possibili applicazioni. I primi otto capitoli sono dedicati alla descrizione dei metodi adeguati per risolvere il cosiddetto problema di Procuste classico, ovvero per l'analisi di due matrici, con particolare attenzione alle trasformazioni definite da rotazioni ortogonali ed oblique. I capitoli 9 e 10 illustrano il caso più generale in cui le matrici poste a confronto sono più di due (problema generalizzato). Particolarmente interessante è la trattazione del capitolo 12, che illustra i legami tra questi ed altri metodi statistici per l'analisi multivariata, in particolare l'analisi della correlazione canonica e i metodi INDSCAL e STATIS per l'analisi dei dati a tre vie. Conclude la trattazione un capitolo che riassume le principali aree di applicazione delle metodologie per l'analisi di Procuste e le più recenti direzioni di ricerca sull'argomento.

g.s.