

## RECENSIONI E SEGNALAZIONI BIBLIOGRAFICHE

P. ČIŽEK, W. HÄRDLE, R. WERON, *Statistical tools for finance and insurance*, Springer-Verlag, Berlin, 2005, pp. 517.

In questo volume, curato da tre accademici europei ma che si avvale anche i contributi di altri autori, vengono trattati i temi più avanzati della finanza quantitativa e delle assicurazioni. Il testo è diviso in tre parti. La prima, costituita da 12 capitoli, è dedicata alla finanza. La seconda, ha 8 capitoli dedicati alle assicurazioni. La terza parte, corrispondente all'ultimo capitolo del volume, descrive il *software XploRe Quantlet Client (XQC)*, il quale permette di implementare alcune delle tecniche descritte. Rispetto alla media dei testi di finanza e assicurazioni, il volume tocca argomenti innovativi focalizzando l'attenzione soprattutto sugli algoritmi di calcolo. Tra questi, la teoria delle distribuzioni e delle copule, gli *implied trinomial trees*, le tecniche di *support vector machine*, il *pricing* di moderni strumenti derivati (*CAT bonds*), simulazione dei *risk processes* e la *ruin theory*. Il volume è di livello abbastanza avanzato ma è corredato da molti esempi, può quindi rappresentare un valido manuale per ricercatori e soprattutto operatori professionali. In alcune parti (*extreme value theory*, copule e *tail dependence*) può essere anche utile per gli studenti dei corsi di laurea specialistica di finanza, o dei master.

*l.f.*

D. RUPPERT, *Statistics and finance*, Springer, New York, 2004, pp. XX+473.

Questo libro di testo coniuga in maniera chiara e vivace gli aspetti metodologici della statistica applicata alla finanza: è da considerarsi una introduzione ad entrambe con un'ottica particolare all'interazione tra le due discipline. La lettura è consigliata a chi già possiede qualche nozione base di statistica, mentre non è richiesta alcuna conoscenza specifica di finanza. Uno studente di statistica non interessato alla finanza può comunque trovare valida la trattazione e chiari gli esempi delle metodologie applicate ai dati finanziari. Nonostante la natura introduttiva del testo, l'Autore espone metodologie statistiche recenti come i modelli GARCH, il *resampling* e la regressione non parametrica. Un ulteriore punto di forza è l'uso per le elaborazioni e gli esempi di due software molto usati e richiesti nel mondo aziendale, quali SAS e MATLAB.

*l.d.a.*

L. A. WALLER, C.A. GOTWAY, *Applied Statistics For Public Health Data*, Wiley, Hoboken, New Jersey, 2004, pp. XVIII+494.

Il volume costituisce un interessante strumento didattico introduttivo all'analisi statistica di dati caratterizzati da informazioni spazialmente referenziate. La trattazione dei vari metodi, proposti in letteratura per questa tipologia di dati, privilegia gli aspetti applicativi. Nello specifico vengono considerate applicazioni di tali metodologie per l'analisi di dati bio-sanitari.

Rivolto ad una ampia varietà di ricercatori offre nei primi tre capitoli una introduzione generale alle esigenze conoscitive che possono derivare dall'analisi di dati bio-sanitari con caratteristiche spaziali, ai metodi analitici di analisi di dati epidemiologici ed infine elementi di cartografia, geodesia ed una introduzione ai GIS. Il capitolo 4 è dedicato ai metodi per la rappresentazione grafica nei problemi di *disease mapping*. Il capitolo 5 è di introduzione all'analisi statistica dei dati spaziali mentre nei capitoli 6 e 7 si focalizza l'attenzione alle metodologie statistiche per l'individuazione di cluster spazialmente caratterizzati. Il capitolo 8 è dedicato ai metodi statistici di mappatura dell'esposizione e ad una introduzione alla geostatistica. Infine il capitolo 9 illustra i modelli per l'analisi della correlazione, sempre in un ottica spaziale, tra esposizione e malattia. E' ampiamente corredato di esempi reali disponibili in un apposito sito *web* unitamente alle sintassi ed agli output offerti dai software statistici che implementano le metodologie illustrate.

*r.m.*

R. HARRIS, P. SLEIGHT, R. WEBBER, *Geodemographics, GIS and Neighbourhood Targeting*, Wiley, Chichester, 2005, XIV+293.

La crescita della potenza di calcolo dei processori ha permesso, con l'ausilio dei sistemi informativi geografici (GIS), l'elaborazione di dati sempre più complessi ed ha dato un notevole impulso allo sviluppo di discipline quali la geodemografia, la geostatistica ed all'analisi spaziale dei dati.

Il volume, nello specifico, illustra le basi metodologiche ed applicative della geodemografia, intesa come l'analisi dei comportamenti di un individuo mediante lo studio delle caratteristiche del luogo in cui vive. In particolare vengono illustrati gli obiettivi, le potenzialità e le criticità di tale disciplina nelle applicazioni al marketing e nel supporto alle decisioni strategiche sia nei settori privati che pubblici.

Gli argomenti vengono affrontati privilegiando gli aspetti applicativi, riducendo al minimo gli aspetti formali dei metodi proposti e ricorrendo ad un vasto repertorio di casi di studio.

E' rivolto agli studenti di marketing, geografia e delle discipline sociali che si avvalgano di informazioni spazialmente referenziate.

*r.m.*

D. COLLETT, *Modelling survival data in medical research*, 2<sup>nd</sup> Ed, Chapman & Hall, 2005, Boca Raton, pp. 381.

La seconda edizione del noto testo di Collett è destinata a ripetere il successo della precedente. Si presenta in una nuova veste aggiornata nei contenuti approfondendo e trattando temi di interesse nell'analisi della sopravvivenza.

Un maggiore spazio è dedicato ai modelli parametrici, ai modelli di accelerazione dei tempi di risposta ed all'analisi dei dati *interval censored*. Gli argomenti sono affrontati in modo chiaro ed attento agli aspetti applicativi del metodo; numerosi, inoltre, sono gli esempi che accompagnano il lettore nei diversi capitoli del libro reperibili in un apposito sito *web*.

*r.m.*