

Cerca



Like 0 Tweet 0

LA STATISTICA E L'ECONOMIA: GLI INDICATORI



di **Paolo Palazzi***

Per tutti coloro che evitano di leggere le pagine economiche di un giornale, per tutti coloro che vorrebbero 'capirci qualcosa di più' o, semplicemente, per tutti coloro che si incuriosiscono sentendo parlare di "Borsa Valori". Ma anche per coloro a cui è piaciuto il film "Una poltrona per due" (Trading Places - 1983).

Negli ultimi decenni la capacità di raccolta, elaborazione e diffusione dei dati è enormemente aumentata in tutti i campi e in tutti i paesi. I dati relativi ai fenomeni economici non fanno eccezione: la capacità di monitorare continuamente, con dati sempre più attendibili, un numero molto elevato di variabili economiche ha fatto passi in avanti decisivi. La disponibilità di **Banche Dati Economici** è inoltre vastissima, quasi tutte disponibili on line e spesso gratuitamente[1].

Questa disponibilità crescente di rilevazioni e dati a disposizione ha però posto due problemi: il primo è relativo alle **tecniche statistiche di rilevazione e di elaborazione dei dati**; il secondo alla necessità di costruire **indicatori sintetici e riassuntivi**.

Per quanto riguarda le tecniche statistiche, si può senz'altro affermare che il livello di sofisticazione delle metodologie ha fatto e continua a fare grandi passi in avanti e la possibilità di utilizzo ormai generalizzato di **software statistici**, ha reso possibile a una larga parte di studiosi la possibilità di elaborazione di grande quantità di dati.

Un altro problema che la disponibilità ampia di dati pone è la necessità, sia per motivi di capacità di previsione, sia per motivi di comunicazione, di avere **indicatori sintetici** in grado di semplificare la comprensione di fenomeni complessi descritti da numerose variabili.

Il dilemma teorico di base per la costruzione di indicatori economici sintetici è quello di trovare un **giusto equilibrio tra la necessità di semplicità e di sintesi e il pericolo di perdita di informazioni importanti**. La costruzione di ogni indice è quindi accompagnata da continue controversie e discussioni fra studiosi, sia relative alle metodologie di calcolo, sia alla scelta delle variabili[2].

Proporremo qui tre esempi relativi a indicatori in tre diversi campi dell'economia: la **Produzione**, lo **Sviluppo Umano** e la **Borsa valori**.

Il PIL (Prodotto Interno Lordo)

La **Produzione**. Il primo indicatore, in ordine di importanza e di utilizzo economico, politico e mediatico è il **Prodotto Interno Lordo (PIL)**, che è un indice composito che tende a stimare il **valore complessivo di tutto**

SCUOLA

- > [Maturità](#)
- > [Dossier](#)
- > [Itinerari](#)
- > [Tesine](#)
- > [Osservatorio](#)
- > [Consulenza](#)
- > [Lezioni](#)
- > [Repetita](#)
- > [Archivio](#)

SCELTI NEL WEB

SCUOLA

La cultura in Rete secondo Treccani.

- BIBLIOTECHE
- SCUOLA
- UNIVERSITÀ

Vedi tutti i link

UN LIBRO



I Promessi Sposi, un'idea di romanzo
Franco Suitner

Vedi tutti i libri

ciò che è stato prodotto (merci e servizi) all'interno di un paese, al lordo della perdita di valore dei macchinari utilizzati. Le difficoltà concettuali e di calcolo di questo aggregato sono innumerevoli e riguardano i metodi di rilevazione, la trasformazione delle quantità prodotte in valore e la valutazione di una serie di produzioni (in genere servizi pubblici) che non hanno un prezzo[3].

Accenno solamente a due problemi: il primo relativo all'attività produttiva sommersa; il secondo alla difficoltà di confronto tra PIL di diversi paesi. Per quanto riguarda la **produzione sommersa**, se ci riferisce all'attività sommersa e/o illegale, le capacità di stima e di calcolo sono andate molto avanti e non si è lontani da avere valutazioni attendibili del fenomeno[4]. Più complessa è invece la stima di tutti i beni che vengono auto prodotti dai cittadini: in questo caso le stime sono più difficili poiché investono non solamente il campo economico, ma anche quello sociale e di costume (si pensi, ad esempio, alla complessità del ruolo della donna nella "produzione" familiare).

Per il confronto internazionale del **PIL** i problemi sono rilevanti ed essenzialmente causati dalla scarsa affidabilità quando si utilizzano per la conversione i **tassi di cambio** ufficiali[5] della **borsa**. Infatti il **PIL**, per essere confrontato tra paesi, va calcolato con un'unica unità di misura monetaria, in genere il dollaro. La soluzione, anche se parziale e imperfetta, è stata quella di calcolare per tutti i paesi un **tasso di cambio** diverso da quello di **borsa**, calcolato invece attraverso indagini e stime dei prezzi effettivi di merci uguali o simili in tutti i paesi. In questo modo il cambio così calcolato rispetta meglio il potere di acquisto dei cittadini dei vari paesi e, applicato al **PIL**, lo trasforma in **PIL** valutato alla **Parità di Potere di Acquisto (PPA)**[6].

L'UNDP

Lo **Sviluppo Umano**. A partire dal 1990 l'**ONU**, attraverso un suo settore, lo **UNDP**, ha proposto un indicatore che fosse meglio in grado di dare un'idea complessiva del livello di sviluppo di un paese, che quindi oltre il **PIL**, tenesse presente anche altri due importanti aspetti: la **Conoscenza**, e la **Salute fisica**. Da quell'anno, ogni anno per tutti i paesi, lo **UNDP** propone un indicatore che consiste in una **Media aritmetica** dei tre aspetti caratterizzanti lo **Sviluppo Umano (Produzione, Istruzione e Salute)** chiamato **Indice di Sviluppo Umano (ISU)**[7]. Anche in questo caso numerosi sono i problemi e le critiche che riguardano sia la scelta delle variabili (ad esempio, l'esclusione di **variabili ecologiche**[8]), sia il metodo di calcolo dell'indice: in particolare l'utilizzo della **Media aritmetica**.

La Borsa Valori

La **Borsa valori** è il luogo principale di contrattazione di **azioni** e **obbligazioni** che nei principali paesi interessano migliaia di prodotti e prezzi, che variano continuamente durante il periodo di apertura delle contrattazioni. Ovviamente i prezzi vanno in tutte le direzioni e di sono di varia intensità: di qui la necessità di avere un indicatore, o più indicatori, sintetici in modo tale da poter avere un'idea generale della dinamica dei prezzi nella giornata. In genere ogni borsa utilizza diversi indicatori selezionando e raggruppando le contrattazioni secondo varie caratteristiche settoriali e di importanza quantitativa. Allora, ad esempio abbiamo in Italia, fra gli altri, vari **MIB**[9]; mentre negli Stati Uniti abbiamo vari indicatori proposti dalla organizzazione **Dow Jones**, e il **Nasdaq**[10]. In genere tutti questi indici non sono altro che semplici **medie** dei prezzi **ponderate** con il volume delle contrattazioni che ogni azione o obbligazione ha registrato nella giornata, in questo modo danno una visione sintetica dei risultati complessivi del mercato.

*Insegna Economia applicata e dello sviluppo presso la Facoltà di Scienze Statistiche dell'Università "La Sapienza" di Roma.

Publicato il 4/2/2010

Italia

Istituto Nazionale di Statistica

Banca d'Italia

Europa

Eurostat

Mondo

World Bank

United Nations

IMF

OECD

[2] Cfr. Predetti A. (2006) , *I numeri indici. Teoria e pratica*, undicesima edizione, Giuffrè Editore, Milano

[3] Calcolo PIL

[4] Per l'Italia cfr. Istat, *La misura dell'economia sommersa secondo le statistiche ufficiali*, Istat 2008

[5] Come altri strumenti finanziari, anche le monete dei paesi più importanti vengono vendute ed acquistate nella **Borsa**. Il prezzo di ogni moneta rispetto alle altre si chiama **tasso di cambio** che cambia continuamente a seconda del rapporto tra domanda e offerta di ogni moneta.

[6] Cfr. Eurostat-OECD, *Methodological Manual on Purchasing Power Parities*, OECD Publishing. Paris 2006,

[7] UNDP, ISU

[8] Di rilievo su questo tema il tenere in considerazione la cosiddetta Impronta ecologica

[9] : **indice composto dai 30 titoli più importanti quotati nella Borsa di Milano: indice medio di tutti i titoli quotati del mercato italiano.**

[10] **Dow Jones: indice delle azioni principali della** Borsa di New York. **Nasdaq:** indice delle quotazioni dei titoli tecnologici