

Metodi Statistici per l'Analisi Socio-Economica

2. La domanda di statistiche economiche

Compiti della statistica economica

Produrre informazioni statistiche che descrivano l'andamento nel tempo e nello spazio dei fenomeni economici.

A questo scopo,
sviluppare concetti, definizioni, classificazioni e metodi.

Tali informazioni sono impiegate per:

- analizzare i comportamenti degli operatori economici
- prevedere la dinamica degli aggregati economici
- prendere decisioni di politica economica o aziendale
- valutare investimenti alternativi

Aspetti concettuali

Ogni misurazione deriva da una certa visione della realtà

- diverse teorie economiche portano allo sviluppo di specifici metodi di misurazione
- lo sviluppo storico della statistica economica è strettamente legato a quello dell'economia

Esempi:

- definizione di ciclo economico
- definizione di benessere/povertà
- definizione di (dis)occupazione

però oggi esiste un quadro generale "abbastanza" condiviso.

Il System of National Accounts

Lo SNA attuale è stato pubblicato nel 2008 da:

- ONU
- OCSE
- FMI
- Banca Mondiale
- Eurostat (versione europea: SEC)

un insieme coerente di concetti, definizioni, classificazioni per la misurazione dell'attività economica
(aggiorna le versioni del 1952, 1968 e del 1993)

Il system of National Accounts (SNA) - 2

Il quadro concettuale dello SNA è di impostazione neoclassica

- l'homo oeconomicus agente razionale e ottimizzante portatore di bisogni economici

limiti dell'approccio neoclassico:

- il capitale sociale
- l'economia comportamentale
- la misurazione del benessere

estensione dello SNA alla contabilità sociale e ambientale: esempio il sistema dei conti ambientali

(ricordiamo come il concetto di esternalità sia in realtà neoclassico)

Gli utenti delle statistiche economiche

Livelli o dinamica temporale? (valori assoluti o variazioni?)

La misurazione dei livelli di certe variabili economiche (esempio: livello dei prezzi) è molto interessante, tuttavia misurare le variazioni è più semplice

- tecnicamente
- (politicamente)

pertanto per molte grandezze sono disponibili più facilmente informazioni relative all'evoluzione nel tempo che a confronti nello spazio

La "salute" del sistema economico

La domanda più frequente rivolta agli statistici economici riguarda la "salute" del sistema economico:

- livello e sviluppo temporale del PIL
- PIL pro capite
- in termini nominali
- in termini reali

Massimizzare il PIL reale per abitante è uno dei principali obiettivi di politica economica (se non il principale); e lo rimane anche se sono nati vari indicatori alternativi di benessere/felicità

Altri tipici settori di interesse

Altri tipici settori di interesse sono:

- I confronti fra aree geografiche/merceologiche
- L'analisi della performance aziendale (fattori di successo)
- L'analisi della storia educativa e lavorativa degli individui (ritorni dell'educazione, povertà, inclusione)

L'evoluzione della statistica economica

L'evoluzione della statistica economica nel tempo dipende, come osservato, da quella delle teorie economiche che ne costituiscono il quadro di riferimento. A loro volta le teorie si evolvono di pari passo con la storia.

- Dal secondo dopoguerra alle crisi petrolifere
- Le politiche economiche attive e gli anni del "boom"
- Gli Anni '70 e la crisi petrolifera
- Dai primi Anni '80 alla globalizzazione
- Gli Anni '90 e l'information society

Dal secondo dopoguerra alle crisi petrolifere

Gli Anni '50:

- La sintesi neoclassica
- L'incremento degli scambi commerciali
- Il cambiamento tecnologico

portano nuove necessità di misurazione dei fenomeni economici.

I lavori di Kuznets, Meade e Stone gettano le basi dello SNA (1952) e influenzano la pratica riguardo a:

- raccolta
- elaborazione
- diffusione

dei dati.

Le politiche economiche attive: gli anni del "boom"

Negli Anni '60 si affermano politiche economiche (fiscali, monetarie) attive e l'idea che le fluttuazioni del sistema economico vadano controllate in modo puntuale (*fine tuning*).

Si sviluppano la teoria economica del controllo ottimale e i metodi econometrici per sistemi di equazioni.

La domanda di statistiche (conti nazionali e settoriali, produzione, occupazione) da parte di organismi pubblici e istituzioni di ricerca pubbliche e private esplose.

Le politiche economiche attive - Continua

Variabili reali:

- produzione
- occupazione
- prezzi di beni e servizi non finanziari

Variabili finanziarie:

- tassi di interesse
- quantità di moneta
- prezzi delle attività finanziarie

Le politiche economiche attive - Continua

L'incremento degli scambi internazionali richiede comparabilità e standardizzazione delle statistiche: nascono/si sviluppano fornitori di statistiche di carattere sovranazionale:

(istituzioni di Bretton Woods)

- ONU
- FMI
- Banca Mondiale

(nuove istituzioni)

- CEE
- OCSE

Gli Anni '70 e la crisi petrolifera

Negli Anni '70 il boom economico del dopoguerra ebbe fine (portando con sé il sistema dei pagamenti di Bretton Woods) e si posero, sull'onda di:

- nuove instabilità di carattere reale (shock petrolifero)
- e monetario (inflazione)
- concorrenza di stagnazione e inflazione ("stagflazione")
- cambio di paradigma della teoria macroeconomica (avvento del monetarismo)
- conseguente spostamento dell'attenzione dalla politica fiscale a quella monetaria

nuove necessità informative per governi e imprese:

- statistiche di carattere monetario e finanziario
- fluttuazioni accentuate
- tempestività delle statistiche

Le selvagge oscillazioni dei prezzi richiedono rapidità di azione da parte dei policymakers (siamo ancora nel mondo interventista del fine tuning)



Gli Anni '70 e la crisi petrolifera - 2

Si sviluppano le istituzioni comunitarie

Oltre ad agricoltura, energia e commercio estero (i primi campi di intervento della CEE) gli standard si estendono a:

- conti economici nazionali
- statistiche congiunturali
- statistiche sulle imprese
- classificazioni merceologiche e delle attività economiche

Gli Anni '70 e la crisi petrolifera - 3

Aumenta l'attenzione verso le statistiche economiche

Il ruolo crescente di:

- sindacati
- associazioni imprenditoriali

nel dibattito di politica economica (salari!)

e la domanda di

- modelli di previsione e
- dati tempestivi

che permettano di seguire l'evoluzione delle crisi valutarie e finanziarie.

Dai primi Anni '80 alla globalizzazione

Il decennio si apre con il secondo shock petrolifero

Nuovi approcci teorici:

- nuova macroeconomia classica
- real business cycle
- supply side economics

...e pratici:

- Reaganomics
- politiche di Margaret Thatcher

L'attenzione si sposta verso il "lato dell'offerta":

- imprese e mercati dei fattori produttivi (beni e lavoro)
- inte(g)razioni orizzontali e verticali tra imprese (gruppi e filiere, outsourcing)
- antitrust

Dai primi Anni '80.. - Sviluppi metodologici

Box e Jenkins 1970

Lo sviluppo della moderna analisi delle serie storiche accresce la domanda di indicatori economici a frequenza infrannuale:

- trimestrali
- mensili

sui fenomeni reali:

- produzione
- occupazione
- scambi

Si sviluppa l'attività di stima e la produzione di indicatori anticipatori per una tempestiva analisi congiunturale

Dai primi Anni '80.. - I mercati finanziari

Gli Anni '80 vedono l'esplosione dei mercati azionari e obbligazionari (e delle borse merci) e finanziari.

Cresce l'attenzione per:

- prezzi delle attività finanziarie
- tassi di interesse
- tassi di cambio

Euforia e crolli si susseguono determinando importanti effetti ricchezza anche sulle famiglie consumatrici.

L'audience dell'informazione economica, soprattutto quella di carattere finanziario, si allarga. Statistiche e previsioni diventano sempre più di interesse generale.

Dai primi Anni '80.. - L'integrazione europea

Il trasferimento di competenze agli organi comunitari e il sempre maggiore flusso di contributi e sovvenzioni verso settori economici o aree svantaggiate richiedono la produzione sempre più

- tempestiva
- dettagliata

di

- dati settoriali
- dati territoriali

per la valutazione delle posizioni relative di ciascun paese e regione. Verso la fine degli Anni '80 il processo di creazione dell'Unione Europea richiede ancora maggiori informazioni e spinge il Consiglio d'Europa a promulgare direttive e regolamenti per incoraggiare le istituzioni statistiche dei singoli paesi verso una maggiore aderenza agli standard internazionali.

Gli Anni '90 e l'information society

Rivoluzione informatica e globalizzazione.

La trasformazione digitale dei processi produttivi grazie alle nuove tecnologie ICT

- produce enormi quantità di dati
- rende disponibili i dati, via Internet, a milioni di utenti.

La centralità degli istituti di statistica viene messa in discussione; allo stesso tempo l'accesso alle informazioni da essi prodotte migliora sensibilmente e la platea di riferimento si espande.

Enti/agenzie privati (ma di carattere sovranazionale) stabiliscono standard contabili comuni per garantire la comparabilità dei dati aziendali.