

Nome docente	Francesco Campobasso Angela Maria D'Ugento
Corso di laurea	Economia e strategie per i mercati internazionali -Magistrale
Insegnamento	Programma di Statistica per le analisi economiche e finanziarie
Anno accademico	2018-2019
Periodo di svolgimento	Primo semestre
Crediti formativi universitari (CFU)	8
Settore scientifico disciplinare	SECS-S01
Pagina web del docente	http://www.uniba.it/ricerca/dipartimenti/dse/dipartimento/personale/personale-docente/docenti/campobasso-francesco

Pre-requisiti

Si richiede una conoscenza di base della metodologia statistica descrittiva e inferenziale.

Conoscenze e abilità da acquisire

Il corso si propone di ampliare la conoscenza degli strumenti statistici utilizzati per la raccolta, l'organizzazione e l'analisi dei dati a supporto delle decisioni in ambito economico-aziendale e finanziario, assunte spesso in condizioni di incertezza, nonché di fornire soluzioni interpretative di casi pratici (analisi di bilancio, studi di settore, revisione contabile). Il programma comprende una parte metodologica, finalizzata a consolidare le conoscenze degli strumenti classici ed una parte applicata, in cui gli stessi concetti vengono declinati evidenziandone l'utilizzo in contesti aziendali e di contabilità pubblica, al fine di far acquisire allo studente una maggior padronanza ed autonomia in ambito professionale.

Il risultato di apprendimento atteso è che lo studente sia in grado di individuare la tecnica di analisi più opportuna in relazione al problema da affrontare, di modellizzare e prospettare soluzioni, interpretarne i risultati e supportare operativamente i processi decisionali.

Programma

Studio delle relazioni tra variabili

Analisi dell'associazione tra due caratteri: Misure di associazione per caratteri quantitativi e qualitativi. Correlazione semplice e parziale. Correlazione spuria. Coefficiente di correlazione parziale di primo ordine e di ordini successivi.

Modello di regressione lineare: Regressione lineare semplice e multivariata. Stima dei parametri del modello tramite il metodo dei minimi quadrati. Coefficienti di regressione parziale e loro interpretazione. Scomposizione della varianza. Coefficiente di determinazione modificato. Violazione delle ipotesi ed analisi dei residui. Inferenza sui parametri tramite test T e test F. Inferenza per la risposta media e la previsione. Variabili dummy. Elaborazioni di statistica descrittiva ed inferenziale con Excel. Il modello di regressione logistica.

Disponibilità e produzione delle informazioni per il supporto alle decisioni

Fonti interne e sistemi informativi aziendali. Fonti esterne, pubbliche e private. Cenni sul Data mining e sue applicazioni per l'analisi dei Big data. La Market basket analysis. La Balanced Scorecard.

Interpretazione dei dati riferiti ai fenomeni aziendali. Numeri indici semplici e complessi. Principali serie di numeri indici dei prezzi. Interpretazione degli indici sintetici e scomposizione delle variazioni nel tempo. I rapporti di rinnovo (turnover) e la mobilità delle unità nel collettivo.

L'analisi delle serie storiche per la programmazione delle attività. Scomposizione delle serie storiche nelle varie componenti. Serie storiche stazionarie e non. Metodi di stima mediante funzione analitica. Metodi di stima mediante medie mobili. Metodi previsivi.

Analisi statistica dei dati di bilancio e degli studi di settore. Riclassificazione del bilancio di esercizio, indici di bilancio e schemi per la loro interpretazione. Benchmarking. Lettura critica della metodologia di base degli studi di settore.

Tecniche di analisi multidimensionale per valutare le prestazioni economico-finanziarie delle imprese: Analisi in componenti principali. Analisi dei gruppi. Analisi discriminante.

Decision analysis: introduzione agli alberi di segmentazione binaria.

Elementi di Sistemi informativi geografici ed applicazioni per l'analisi statistica territoriale.

Bibliografia

Dispense a cura dei docenti. Materiale didattico aggiuntivo a cura del docente e disponibile su piattaforma online all'indirizzo <http://economia.osel.it> (la password è comunicata dal docente all'inizio del corso o su richiesta dello studente).

S. Borra, A. Di Ciaccio (2008), *Statistica – Metodologie per le scienze economiche e sociali*, McGraw-Hill, Milano (Capp. 5, 6, 7, 14, 16, 17 e 19).

L. Biggeri, M. Bini, A. Coli, L. Grassini, M. Maltagliati (2012), *Statistica per le decisioni aziendali*, Pearson, Milano (Capp. 1, 2, 3, 5, 6, 8).

C. Cortinhas, K. Black, *Statistics for Business and Economics*, Wiley, UK, 2012 (Cap. 19).

Note metodologiche degli studi di settore disponibili on line.

Modalità di accertamento conoscenze

- Esoneri: No
- Prova Scritta: No
- Colloquio Orale: Sì

Organizzazione della didattica

- Cicli interni di lezione: No
- Corsi integrativi: No
- Esercitazioni: Sì (anche tramite l'utilizzo di supporti informatici)
- Seminari: Sì
- Attività di laboratorio: No
- Project work: No
- Visite di studio: No

Modalità di erogazione delle attività formative

- Lezioni frontali su argomenti teorici ed esercitazioni sugli stessi argomenti.
- Seminari di approfondimento su temi specifici con utilizzo di software dedicati.

Modalità di valutazione delle attività formative

La valutazione delle attività formative avviene alla fine del corso con una prova di esame orale in cui lo studente deve dimostrare il livello di conoscenze acquisite nonché di essere in grado di applicare le metodologie statistiche di analisi statistica bivariata e multivariata, anche attraverso la soluzione di esercizi assegnati in sede d'esame o il commento di output di analisi multivariate proposti. La parte teorica e quella applicata concorrono a formare la valutazione finale in egual misura. L'eventuale esito negativo della prova d'esame sostenuta non pregiudica la possibilità di sostenere l'esame a partire dall'appello successivo.