

<b>Nome docente</b>	Francesco Campobasso Angela Maria D'Uggento
<b>Corso di laurea</b>	Economia e strategie per i mercati internazionali (magistrale)
<b>Anno accademico</b>	2017-2018
<b>Periodo di svolgimento</b>	Primo semestre
<b>Crediti formativi universitari (CFU)</b>	8
<b>Settore scientifico disciplinare</b>	SECS-S01

**Programma di Statistica per le analisi economiche e finanziarie (a.a. 2017-2018)**  
(Prof. Francesco Campobasso, Prof.ssa Angela Maria D'Uggento)

**Università degli Studi di Bari Aldo Moro**  
**Dipartimento di Economia e Finanza**  
**Corso di Laurea Magistrale in Economia e strategie per i mercati internazionali**

**Pre-requisiti**

Si richiede una conoscenza di base della statistica descrittiva e inferenziale

**Obiettivi del corso**

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 economiche, assunte spesso in condizioni di incertezza, nonché di fornire soluzioni interpretative di casi pratici (analisi di bilancio, studi di settore, revisione contabile).

**Programma**

**Studio delle relazioni tra variabili**

Analisi dell'associazione tra due caratteri (argomenti tratti dai capp. 6, 7 e 14 Borra Di Ciaccio e dalle dispense): 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 (argomenti tratti dai capp.16, 17 e 19 Borra Di Ciaccio, dal capp. 6 e 8 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati e dalle dispense): 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**

(cap. 2 Biggeri e dispense docente): Fonti interne e sistemi informativi aziendali. Cenni sul Data mining e sue applicazioni per l'analisi dei dati aziendali. Market basket analysis. Balanced Scorecard.

**Numeri indici** (cap. 5 Borra Di Ciaccio; cap. 3 Biggeri ): 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.

**Serie storiche** (cap. 7 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati e dispense): 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** (argomenti tratti dal cap.8 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati e dalle note metodologiche degli studi di settore disponibili on-line): 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 (argomenti tratti dal cap. 8 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati): Analisi in componenti principali. Analisi dei gruppi. Analisi discriminante.

**Decision analysis** (argomento tratto dal cap. 19 C. Cortinhas, K. Black): introduzione agli alberi di segmentazione binaria.

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

### **Bibliografia**

*Dispense a cura dei docenti.*

S. Borra, A. Di Ciaccio (2008), *Statistica – Metodologie per le scienze economiche e sociali*, McGraw-Hill, Milano;

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)

P. Giudici, *Data Mining. Metodi informatici, statistici e applicazioni 2/ed*, McGraw-Hill, Milano, 2005 (per approfondimenti).

Note metodologiche degli studi di settore disponibili on line.

### **Modalità di accertamento conoscenze**

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

### **Forme di assistenza allo studio**

- Corso presente nella zona in e-learning del Sito Web di Facoltà: No
- Gli studenti potranno ricevere aiuto nella comprensione degli argomenti trattati durante il corso nei giorni di ricevimento

### **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