

Nome docente	Francesco Campobasso
Corso di laurea	Economia e Commercio (magistrale)
Anno accademico	2014-2015
Periodo di svolgimento	Secondo semestre
Crediti formativi universitari (CFU)	8
Settore scientifico disciplinare	SECS-S01

Programma di Metodi statistici per le decisioni economiche (a.a. 2014/2015)
(Prof. Francesco Campobasso)

Università degli Studi di Bari Aldo Moro
Dipartimento di Scienze Economiche e Metodi Matematici
Corso di Laurea Magistrale in Economia e Commercio

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

Analisi dell'associazione tra due caratteri (argomenti tratti dai capp. 6, 7 e 14 Borra Di Ciaccio e dalle dispense Grassini): Distribuzione doppia di frequenze, indipendenza, dipendenza, interdipendenza. Misure di associazione per caratteri quantitativi e qualitativi. Il problema degli effetti esterni. 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 cap. 6 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati e dalle dispense Grassini): 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. Cenni sul modello di regressione logistica.

Numeri indici (cap. 5 Borra Di Ciaccio) e Serie storiche (cap. 7 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati e dispense Grassini): Numeri indici semplici. Passaggio da una base all'altra. Numeri indici complessi e proprietà. Principali serie di numeri indici dei prezzi. 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.

Campionamento, stima intervallare e verifica di ipotesi nella revisione aziendale (argomenti tratti dai capp. 10, 11, 12 e 14 Borra Di Ciaccio e dalle dispense di Grassini): Popolazione e parametri della popolazione. Statistiche campionarie e distribuzioni campionarie. Teorema del limite centrale. Stima puntuale e intervallare della media e della proporzione di una popolazione. Verifica di ipotesi. Controllo delle poste di bilancio tramite rilevazioni campionarie.

Tecniche di analisi multidimensionale per valutare le prestazioni economico-finanziarie delle imprese (argomenti tratti dal cap. 8 Biggeri, Bini, Coli, Grassini, Maltagliati): Analisi dei gruppi. Analisi in componenti principali. Analisi discriminante. Analisi logit.

Analisi statistica dei dati di bilancio e degli studi di settore (dispense Grassini, note metodologiche degli studi di settore disponibili on-line): Riclassificazione del bilancio di esercizio, indici di bilancio e schemi per la loro interpretazione. Lettura critica della metodologia di base degli studi di settore.

Bibliografia

- a) S. Borra, A. Di Ciaccio (2008), *Statistica – Metodologie per le scienze economiche e sociali*, McGraw-Hill, Milano;
- b) L. Biggeri, M. Bini, A. Coli, L. Grassini, M. Maltagliati (2012), *Statistica per le decisioni aziendali*, Pearson, Milano;
- c) L. Grassini, *Dispense e lucidi del corso di “Statistica aziendale”*, Università degli Studi di Firenze (disponibili nella sezione “materiale didattico” di questo sito);
- d) Note metodologiche degli studi di settore disponibili on line.

Modalità di accertamento conoscenze

- Esoneri: Sì
- Prova Scritta: Sì
- 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