

CORSO DI STUDIO *Laurea magistrale in Economia e Finanza*
ANNO ACCADEMICO *2023-2024*
DENOMINAZIONE DELL'INSEGNAMENTO *Analisi quantitative per le decisioni economico-finanziarie*

Principali informazioni sull'insegnamento	
Anno di corso	<i>1 anno</i>
Periodo di erogazione	<i>Il semestre (19-02-2024 / 29-03-2024 e 15-04-2024 / 07-06- 2024)</i>
Crediti formativi universitari (CFU/ETCS):	<i>8 CFU</i>
SSD	<i>SECS S01</i>
Lingua di erogazione	<i>Italiano</i>
Modalità di frequenza	<i>Facoltativa</i>

Docente	
Nome e cognome	<i>Francesco Campobasso</i>
Indirizzo mail	<i>francesco.campobasso@uniba.it</i>
Telefono	<i>080/5049206</i>
Sede	<i>Dipartimento di Economie e Finanza / Largo Abbazia S. Scolastica - 70124 Bari</i>
Sede virtuale	<i>Codice Teams da condividere con gli studenti</i>
Ricevimento	<i>Al termine di ogni lezione</i>

Organizzazione della didattica			
Ore			
Totali	Didattica frontale	Pratica (laboratorio, campo, esercitazione, altro)	Studio individuale
<i>200</i>	<i>56</i>		<i>144</i>
CFU/ETCS			
<i>8</i>	<i>56</i>		

Obiettivi formativi	<i>Il corso è finalizzato ad ampliare la conoscenza degli strumenti 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 nei relativi casi pratici.</i>
Prerequisiti	<i>Si richiede una conoscenza di base della metodologia statistica descrittiva e inferenziale, nonché delle tecniche di analisi di bilancio per il controllo delle performance economico-finanziarie</i>

Metodi didattici	<i>Didattica frontale, comprensiva dell'analisi di casi pratici</i>
-------------------------	---

Risultati di apprendimento previsti <i>Da indicare per ciascun Descrittore di Dublino (DD=</i>	<ul style="list-style-type: none"> - Descrittore di Dublino 1: <i>conoscenza e capacità di comprensione</i> <ul style="list-style-type: none"> o Tecniche di analisi multivariata o Valutazione delle performance economico-finanziarie - Descrittore di Dublino 2: <i>capacità di applicare conoscenza e comprensione</i> <ul style="list-style-type: none"> o Gestione dei dati o Benchmarking o Previsioni sullo stato di salute di un'azienda - Descrittore di Dublino 3: <i>capacità critiche e di giudizio</i> <i>Al termine dell'insegnamento lo/la studente/studentessa dovrà essere in grado di</i> <ul style="list-style-type: none"> o Assumere decisioni in condizioni di incertezza, avendo acquisito
--	---

<p>DD1 Conoscenza e capacità di comprensione</p> <p>DD2 Conoscenza e capacità di comprensione applicate</p> <p>DD3-5 Competenze trasversali</p>	<p>maggiore dimestichezza nell'affrontare casi pratici in ambito economico-finanziario</p> <p>- Descrittore di Dublino 4: capacità di comunicare quanto si è appreso Al termine dell'insegnamento lo/la studente/studentessa dovrà essere in grado di</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ interagire con gli stakeholder dell'istituzione economico-finanziaria <p>- Descrittore di Dublino 5: capacità di proseguire lo studio in modo autonomo nel corso della vita Al termine dell'insegnamento lo/la studente/studentessa dovrà essere in grado di</p> <ul style="list-style-type: none"> ○ risultare versatile, riuscendo ad adeguare le proprie decisioni al contesto di riferimento ○ modellizzare e prospettare soluzioni, interpretare i risultati del modello e supportare operativamente i processi decisionali.
<p>Contenuti di insegnamento (Programma)</p>	<p><i>Misure di associazione per caratteri quantitativi e qualitativi. Dipendenza. Regressione lineare semplice e multivariata. Funzione di Cobb Douglass. Scelta delle variabili. Variabili dummy. Violazione delle ipotesi ed analisi dei residui. Regressione logistica. Applicazioni in ambito finanziario (misurazione del rischio degli strumenti finanziari, varianza di un portafoglio, capital asset pricing model).</i></p> <p><i>Serie storiche e scomposizione nelle varie componenti. Serie storiche stazionarie e non. Metodi di stima mediante funzione analitica e mediante medie mobili. Metodi previsivi. Numeri indici semplici e complessi.</i></p> <p><i>Analisi statistica dei dati di bilancio. Balanced scorecard. Indicatori delle dichiarazioni non finanziarie. Riclassificazione del bilancio di esercizio, indici di bilancio e schemi per la loro interpretazione. Benchmarking. Utilizzo dei metodi statistici nel controllo di gestione (determinazione del break even point, leva operativa, budgeting).</i></p> <p><i>Tecniche di analisi multidimensionale per valutare le prestazioni economico-finanziarie delle imprese (analisi in componenti principali, analisi dei gruppi, analisi discriminante, curva Roc). Gli indicatori della crisi d'impresa e modello di Altman. Cenni sull'utilizzo dei metodi statistici nel controllo di gestione e nell'analisi dei margini e dei flussi finanziari. Test pratico per la verifica della ragionevole perseguibilità del risanamento e check list per la redazione del piano di risanamento di cui al Decreto Dirigenziale del Ministero Giustizia del 28.09.2021</i></p>
<p>Testi di riferimento</p>	<p><i>Borra, A. Di Ciaccio (2008), Statistica – Metodologie per le scienze economiche e sociali, McGraw-Hill, Milano (Capp. 5, 6, 16, 17 e 19).</i></p> <p><i>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).</i></p>

Note ai testi di riferimento	<i>Approfondimenti trattati in aula anche con riferimento a casi pratici</i>
Materiali didattici	<i>Dispense/slide disponibili sul sito del docente.</i>
Valutazione	
Modalità di verifica dell'apprendimento	<p><i>La verifica avviene alla fine del corso con una prova di esame orale in cui lo studente deve dimostrare il livello di conoscenze acquisite e di essere in grado di individuare la tecnica di analisi più opportuna in relazione al problema da affrontare, anche attraverso la soluzione di esercitazioni assegnate o il commento dell'output di analisi multivariate proposte.</i></p> <p><i>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.</i></p>
Criteri di valutazione	<p><i>Ciascuno dei seguenti ambiti oggetto di valutazione concorrerà paritariamente all'esito finale dell'esame:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>Conoscenza e capacità di comprensione</i> • <i>Conoscenza e capacità di comprensione applicate</i> • <i>Autonomia di giudizio</i> • <i>Abilità comunicative</i> • <i>Capacità di apprendere</i>
Criteri di misurazione dell'apprendimento e di attribuzione del voto finale	<p><i>Il voto finale è attribuito in trentesimi; l'esame si intende superato quando il voto è maggiore o uguale a 18.</i></p> <p><i>Le competenze trasversali previste nei risultati di apprendimento incidono sulla valutazione finale, perché lo/la studente/studentessa deve avere sviluppato autonomia di giudizio e adeguata capacità di argomentazione ed esposizione.</i></p>
Altro	