

Nome docente	TROIANI SAVERIO
Corso di laurea	SCIENZE STATISTICHE
Anno accademico	2015-2016
Periodo di svolgimento	II SEMESTRE
Crediti formativi universitari (CFU)	6
Settore scientifico disciplinare	SECS-S/03

Programma di STATISTICA AZIENDALE (A. A. 2015/2016)
(Prof. Troiani Saverio)

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

Pre-requisiti

Non vi sono particolari pre-requisiti.

Obiettivi del corso

L'obiettivo del corso è quello di mettere gli studenti in condizione di conoscere ed affrontare alcune tematiche tipiche della realtà aziendale che richiedono l'impiego di metodi statistici.

Programma

Dai dati alle informazioni.

Le "statistiche" nella gestione aziendale. Quadri di controllo e "cruscotti aziendali". L'estrazione delle informazioni. Analisi delle principali tecniche di DATA MINING (alberi classificazione, regole associative, reti neurali, algoritmi genetici, ecc.)

Le decisioni in ambito aziendale.

I criteri decisionali. Gli alberi delle decisioni. La revisione bayesiana.

Le previsioni in ambito aziendale

L'importanza dell'attività previsiva. Analisi dei principali metodi previsivi. Le previsioni di borsa con l'analisi tecnica e l'analisi algoritmica.

Il campionamento nella revisione aziendale

Il modello del rischio di revisione. I piani di campionamento (di stima, di individuazione, di accettazione). La formazione dei campioni (criteri RANDOM e MUS). La verifica dei risultati.

Le analisi di settore.

Funzione e logica dell'analisi statistica dei bilanci. L'analisi delle *performance*. I valori medi di settore come valori obiettivo (*benchmark*). Matrici di posizionamento ed efficienza produttiva (*Data Envelopment Analysis*). L'analisi degli scostamenti.

La diagnosi aziendale

Le crisi aziendali ed i rischi di insolvenza. La previsione delle insolvenze: metodi univariati e multivariati, parametrici e non parametrici.

La gestione del rischio di credito

Credit Scoring e Rating. I sistemi di *rating*. Il valore a rischio (VaR). La misurazione del VaR: il modello *Credit Metrics*

Dispense dalle lezioni. Versione 2015

Testi di approfondimento

M.BERRY - G.LINOFF: *Data Mining*, Apogeo, Milano, 2001

S.MAKRIDAKIS – S.WHELLRIGHT: *The Handbook of Forecasting: A Managers's Guide*, John Wiley & Sons, N.Y.

H.ARKIN: *Handbook of Sampling for Auditing and Accounting*, vol.1 Methods, McGraw-Hill Book Company, N.Y., 1993.

L.BARBARITO: *L'analisi di settore. Metodologia ed applicazioni*, Franco Angeli Milano, 1999.

E.I.ALTMAN: *Corporate Financial Distress and Bankruptcy*, John Wiley & Sons, N.Y. 1993

F.VARETTO: *Il sistema di diagnosi dei rischi della Centrale dei Bilanci*, Bancaria Editrice, Roma, 1990.