

CORSO DI STUDIO: SCIENZE STATISTICHE
ANNO ACCADEMICO: 20232024
DENOMINAZIONE DELL'INSEGNAMENTO: ANALISI DELLE SERIE STORICHE

| Principali informazioni sull'insegnamento | |
|--|--|
| Anno di corso | III ANNO |
| Periodo di erogazione | II SEMESTRE (febb 2024 – giu 2024) |
| Crediti formativi universitari (CFU/ETCS): | 8 |
| SSD | SECS-S/03 |
| Lingua di erogazione | Italiano |
| Modalità di frequenza | Facoltativa, ma fortemente consigliata |

| Docente | |
|----------------|--|
| Nome e cognome | Caterina Marini |
| Indirizzo mail | caterina.marini@uniba.it |
| Telefono | 080-5049204 |
| Sede | Dipartimento di Economica e Finanza – V Piano Largo Abbazia S. Scolastica – Bari. POSTCODE: 70124 |
| Sede virtuale | MTeam "Analisi delle Serie Storiche". Codice "6dsbtex" |
| Ricevimento | Modalità di Ricevimento in presenza: mercoledì, 10:30 – 12:30 |

| Organizzazione della didattica | | | |
|--------------------------------|-----------------------|--|--------------------|
| Ore | | | |
| Totali | Didattica in presenza | Pratica (laboratorio, campo, esercitazione, altro) | Studio individuale |
| 200 | 35 | 21 | 144 |
| CFU/ETCS | | | |
| 8 | 5 | 3 | |

| | |
|----------------------------|---|
| Obiettivi formativi | <i>Il corso si propone di fornire allo studente gli elementi di base necessari per lo sviluppo dell'analisi stocastica delle serie storiche economiche e dei modelli multidimensionali econometrici connessi.</i> |
| Prerequisiti | <i>Adeguata conoscenza di base di Statistica Inferenziale, Statistica Economica, Economia, Analisi Matematica e Algebra delle Matrici</i> |

| | |
|-------------------------|--|
| Metodi didattici | <i>Nella fase di acquisizione della conoscenza, la didattica frontale è il metodo d'insegnamento principale. L'attività di laboratorio, esercitazioni e l'analisi di fenomeni reali attraverso l'implementazione della conoscenza acquisita completano la possibilità di comprensione dei contenuti. Le Esercitazioni saranno sviluppate con l'uso del software econometrico GRETL utilizzando le banche dati economiche online nazionali (ISTAT) ed europee (EUROSTAT).</i> |
|-------------------------|--|

| | |
|--|--|
| Risultati di apprendimento previsti | - <i>Conoscere gli elementi necessari per l'analisi temporale dei fenomeni economici attraverso l'utilizzo di modelli dinamici uniequazionali al fine di identificare e interpretare le relazioni economiche tra le variabili che caratterizzano la struttura dei fenomeni stessi, nonché dei modelli comportamentali delle unità economiche, sia a livello macroeconomico, sia a livello microeconomico, utilizzabili a fini previsivi.</i> |
| DD1 Conoscenza e capacità di comprensione | <i>Lo studente/la studentessa sarà in grado di:</i> - <i>acquisire la capacità di riconoscere la struttura e la tipologia di modelli che utilizzano il dato in serie storica;</i> - <i>gestire le criticità metodologiche che l'utilizzo del campione in serie storica comporta;</i> |

| | |
|---|---|
| <p>DD2 Conoscenza e capacità di comprensione applicate</p> | <ul style="list-style-type: none"> - <i>acquisire le competenze metodologiche per la definizione e l'analisi dei modelli statistici dinamici multivariati uniequazionali;</i> - <i>effettuare analisi di base complesse in relazione all'evoluzione storica delle variabili in diversi campi applicativi.</i> <p><i>Lo studente/la studentessa sarà in grado di:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>applicare le conoscenze acquisite agli specifici casi concreti che si presentano nell'analisi dei fenomeni reali;</i> - <i>interpretare i fenomeni economici legati alle scelte individuali e collettive.</i> |
| <p>DD3-5 Competenze trasversali</p> | <p><i>Il corso si pone l'obiettivo di dotare gli studenti di strumenti che consentano loro di:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>sviluppare con senso critico e oggettivo una capacità di analisi esaustiva dei fenomeni economici reali;</i> - <i>essere in grado di interpretare e comunicare i risultati delle analisi agli interlocutori esterni relativamente alle decisioni e agli interventi strutturali e congiunturali in ambito economico;</i> - <i>comprendere la natura dei fenomeni studiati e sviluppare la capacità di applicare coerentemente le corrette metodologie necessarie alla comprensione dei fenomeni stessi.</i> |
| <p>Contenuti di insegnamento (Programma)</p> | <p><i>Parte I: Introduzione all'analisi delle serie storiche</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>Lo studio dei fenomeni che variano nel tempo.</i> - <i>Econometria e analisi delle serie storiche.</i> - <i>Processi stocastici, caratteristiche generali.</i> - <i>Processi stazionari, invertibili, ergodici.</i> <p><i>Parte II: Modelli Econometrici di serie storiche</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - <i>Modelli univariati e multivariati di serie storiche.</i> - <i>Esogeneità, causalità, identificazione nei modelli econometrici.</i> - <i>La stima e la verifica di ipotesi dei modelli lineari dei modelli univariati.</i> - <i>Analisi della specificazione nei modelli econometrici: scelta e validazione del modello.</i> |
| <p>Testi di riferimento</p> | <ul style="list-style-type: none"> - <i>A. Gardini, G. Cavaliere, M. Costa, L. Fanelli, P. Paruolo - Econometria. Volume I, Franco Angeli Editore, Milano 2003.</i> - <i>J.D. Hamilton - Time Series Analysis, Princeton University Press, Princeton, New Jersey 1994.</i> - <i>Dispense del docente.</i> |
| <p>Note ai testi di riferimento</p> | |
| <p>Materiali didattici</p> | <p><i>Le dispense e il materiale d'esercitazione viene reso disponibile dal docente in formato elettronico.</i></p> |

| | |
|--|---|
| <p>Valutazione</p> | |
| <p>Modalità di verifica dell'apprendimento</p> | <p><i>L'accertamento delle conoscenze dello studente/della studentessa avviene esclusivamente attraverso una prova orale, durante la quale sono valutate le conoscenze teoriche sulle tematiche del corso, nonché la capacità di valutare le implicazioni delle suddette conoscenze sulla valutazione economica dei fenomeni reali, sulla scorta delle analisi effettuate durante le lezioni frontali e le esercitazioni in aula.</i></p> |
| <p>Criteri di valutazione</p> | <p><i>Lo studente/la studentessa dovrà mostrare una buona conoscenza degli argomenti affrontati nello svolgimento del corso e una relativa buona capacità espositiva degli stessi, utilizzando in maniera opportuna il lessico specialistico. Inoltre, dovrà mostrare capacità di ragionamento critico sullo studio realizzato.</i></p> |
| <p>Criteri di misurazione dell'apprendimento e di attribuzione del voto finale</p> | <p><i>Il voto finale è attribuito in trentesimi e l'esame si intende superato quando il voto è maggiore o uguale a 18/30.</i></p> |
| <p>Altro</p> | |

