

| | |
|---|---|
| Nome docente | Francesco Campobasso Angela Maria D'Uggento |
| Corso di laurea | Economia e strategie per i mercati internazionali (magistrale) |
| Anno accademico | 2016-2017 |
| Periodo di svolgimento | Primo semestre |
| Crediti formativi universitari (CFU) | 8 |
| Settore scientifico disciplinare | SECS-S01 |

Programma di Statistica per le analisi economiche e finanziarie (a.a. 2016/2017)
(Prof. Francesco Campobasso, Prof.ssa Angela Maria D'Uggento)

Università degli Studi di Bari Aldo Moro
Dipartimento di Scienze Economiche e Metodi Matematici
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.

L'efficienza e la valutazione delle performance. Concetti introduttivi alla Data Envelopment Analysis.

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.

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.

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