

|   |   |
|---|---|
| <b>Nome docente</b>                         | Angela Maria D'Uggento  |
| <b>Corso di laurea</b>                      | Statistica e Metodi per l'Economia e la Finanza -Magistrale   |
| <b>Insegnamento</b>                         | Statistica per le analisi economiche e finanziarie  |
| <b>Anno accademico</b>                      | 2018/2019   |
| <b>Periodo di svolgimento</b>               | Primo semestre  |
| <b>Crediti formativi universitari (CFU)</b> | 6   |
| <b>Settore scientifico disciplinare</b>     | SECS-S01  |
| <b>Pagina web del docente</b>               | <a href="http://www.uniba.it/ricerca/dipartimenti/dse/dipartimento/personale/personale-docente/docenti/duggento-angela-maria/angela-maria-duggento">http://www.uniba.it/ricerca/dipartimenti/dse/dipartimento/personale/personale-docente/docenti/duggento-angela-maria/angela-maria-duggento</a> |

### Pre-requisiti

Conoscenza approfondita della metodologia statistica descrittiva univariata, multivariata ed inferenziale.

### Conoscenze ed abilità da acquisire

- Ampliare le conoscenze sull'utilizzo degli strumenti metodologici per effettuare le analisi in ambito economico-aziendale, finanziario e per supportare i processi decisionali, in ambito privato e pubblico.
- Familiarità ed autonomia nell'applicazione dei metodi di analisi statistica univariata e multivariata ai dati economici o provenienti da altri contesti applicativi, con particolare rilevanza all'intero processo di produzione delle informazioni, partendo dalle fasi di acquisizione, organizzazione ed elaborazione dei dati, in un'ottica di *problem solving* di casi concreti.
- Il risultato di apprendimento atteso è che lo studente sia in grado di individuare la tecnica di analisi più opportuna in relazione al problema da affrontare, di modellizzare e prospettare soluzioni, interpretarne i risultati e supportare operativamente i processi decisionali.

### Programma

Disponibilità e produzione delle informazioni per il supporto alle decisioni. Fonti interne e sistemi informativi aziendali. Fonti esterne, pubbliche e private. Cenni sul Data mining per l'analisi dei Big data. La Market basket analysis. La Balanced Scorecard.

Interpretazione dei dati riferiti a fenomeni aziendali. 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.

L'analisi delle serie storiche per la programmazione delle attività. 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.

Valutazione delle prestazioni economico-finanziarie delle imprese. Analisi statistica dei dati di bilancio e degli studi di settore. 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: Analisi in componenti principali. Analisi dei gruppi. Analisi discriminante.

Decision analysis: introduzione agli alberi di segmentazione binaria.

Elementi di Sistemi informativi geografici ed applicazioni per l'analisi statistica territoriale.

## **Bibliografia**

Materiale didattico aggiuntivo a cura del docente e disponibile su piattaforma online all'indirizzo <http://economia.osel.it> (la password è comunicata dal docente all'inizio del corso o su richiesta dello studente).

L. Biggeri, M. Bini, A. Coli, L. Grassini, M. Maltagliati (2012), *Statistica per le decisioni aziendali*, Pearson, Milano (Capp. 1, 2, 3, 7, 8).

C. Cortinhas, K. Black, *Statistics for Business and Economics*, Wiley, UK, 2012 (Cap. 19).

Note metodologiche degli studi di settore disponibili on line.

## **Modalità di accertamento conoscenze**

- Esoneri: No
- Prova Scritta: No
- Colloquio Orale: Sì

## **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

## **Modalità di erogazione delle attività formative**

- Lezioni frontali su argomenti teorici ed esercitazioni sugli stessi argomenti.
- Seminari di approfondimento su temi specifici con utilizzo di software dedicati.

## **Modalità di valutazione delle attività formative**

La valutazione delle attività formative avviene alla fine del corso con una prova di esame orale in cui lo studente deve dimostrare il livello di conoscenze acquisite nonché di essere in grado di applicare le metodologie statistiche di analisi statistica bivariata e multivariata, anche attraverso la soluzione di esercizi assegnati in sede d'esame o il commento di output di analisi multivariate proposti. 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.