

Economia finanza e assicurazioni (LM16)

(Lecce - Università degli Studi)

Insegnamento ANALISI DELLE SERIE STORICHE

GenCod A001255

Docente titolare Sandra DE IACO

Insegnamento ANALISI DELLE SERIE STORICHE

Insegnamento in inglese TIME SERIES

Settore disciplinare SECS-S/01

Corso di studi di riferimento Economia finanza e assicurazioni

Tipo corso di studi Laurea Magistrale

Crediti 8.0

Ripartizione oraria Ore Attività frontale: 64.0

Per immatricolati nel 2017/2018

Erogato nel 2017/2018

Anno di corso 1

Lingua ITALIANO

Percorso PERCORSO COMUNE

Sede Lecce

Periodo Primo Semestre

Tipo esame Orale

Valutazione Voto Finale

Orario dell'insegnamento

<https://easyroom.unisalento.it/Orario>

PREREQUISITI

conoscenze di Statistica inferenziale e di analisi matematica

OBIETTIVI FORMATIVI

Il corso si propone di fornire concetti, metodologie e strumenti dell'Analisi delle Serie Storiche, al fine di descrivere, interpretare e prevedere la dinamica temporale di una o più variabili riguardanti un determinato fenomeno (ad esempio, i principali indicatori economici).

METODI DIDATTICI

Lezioni frontali con uso di supporti audiovisivi, esercitazioni in aula

MODALITA' D'ESAME

Prova orale

Nell'ambito della prova orale si discute anche un saggio scritto elaborato durante le lezioni su un argomento specifico assegnato durante le lezioni frontali.

In seguito allo svolgimento della prova orale, viene redatto apposito verbale, sottoscritto dal Presidente e dai membri della commissione e dallo studente esaminato. Il superamento dell'esame presuppone il conferimento di un voto non inferiore ai diciotto/trentesimi (con eventuale assegnazione della lode) e prevede l'attribuzione dei corrispondenti CFU.

"Lo studente, disabile e/o con DSA, che intende usufruire di un intervento individualizzato per lo svolgimento della prova d'esame deve contattare l'ufficio Integrazione Disabili dell'Università del Salento all'indirizzo paola.martino@unisalento.it"

Non sono previste differenze in termini di programma, testi e modalità d'esame tra studenti frequentanti e non frequentanti.

ALTRE INFORMAZIONI UTILI

Commissione di esame:

De Iaco Sandra (presidente); Posa Donato (componente); Maggio Sabrina (componente); Palma Monica (componente)

Risultati attesi secondo i descrittori di Dublino:

Conoscenza e capacità di comprensione (knowledge and understanding):

- Acquisizione dei concetti, delle metodologie e degli strumenti per l'Analisi delle Serie Storiche, al fine di descrivere, interpretare e prevedere le dinamiche temporali di una o più variabili economico-finanziarie.

- Conoscenza dei metodi induttivi dell'Analisi delle Serie Storiche per la stima e la verifica dei parametri di modelli stocastici utilizzabili a scopi previsivi e decisionali.

- Conoscenza e uso dei principali software statistici per l'analisi delle serie storiche (SPSS, Gretl).

Capacità di applicare conoscenza e comprensione (applying knowledge and understanding)

- Capacità di interpretare l'evoluzione temporale di fenomeni economici e finanziari mediante l'analisi statistica delle serie storiche e la costruzione di modelli idonei, anche con l'impiego di strumenti di calcolo avanzati e di algoritmi sofisticati.

- Presentazione e interpretazione critica dei risultati previsivi in ambito economico e finanziario.

Autonomia di giudizio (making judgements)

- Capacità di utilizzare i risultati delle analisi dei dati per formulare ipotesi interpretative, ricavarne indicazioni strategiche, prendere decisioni in condizioni di incertezza.

- Capacità di tradurre in termini statistici una esigenza conoscitiva nell'ambito dello studio delle dinamiche temporali dei fenomeni economico-finanziari.

Abilità comunicative (communication skills)

- Capacità di cogliere e di definire/circoscrivere l'obiettivo statistico di uno studio con interlocutori non esperti.

- Capacità di presentare, anche con l'ausilio di tecniche audiovisive, i metodi, i risultati e l'interpretazione

statistica di uno studio sia ad esperti del contesto applicativo che a specialisti nel campo statistico ed economico-finanziario.

Capacità di apprendimento (learning skills)

- Capacità di integrare le proprie conoscenze adattandosi alle diverse realtà e all'evoluzione della disciplina.

PROGRAMMA ESTESO

Obiettivi dell'analisi di una serie storica. Tecniche descrittive. Serie storiche stazionarie. Tipi di trasformazione per una serie storica. Autocorrelazione. Il correlogramma e sua interpretazione. Modelli di probabilità per una serie storica. Processi stocastici. Processi stazionari. Stazionarietà del secondo ordine. Processi autoregressivi e processi a media mobile. Modelli misti. Modelli integrati. Stima delle funzioni di correlazione. Stima dei parametri per i diversi modelli. Previsione. Applicazioni.

TESTI DI RIFERIMENTO

- Dispense del docente disponibili nella pagina personale in corrispondenza della sezione "Risorse Correlate".

- The Analysis of Time Series: An Introduction - C. Chatfield, Chapman & Hall/CRC Texts in Statistical Science, 330 p. (only the first 5 chapters)