

STATISTICA ECONOMICA (TNO)

Docente/i: CHIRICO PAOLO
Settore: SECS-S/03
CFU: 9
Sede: TORINO

PROGRAMMA D'ESAME A.A.: 2009-2010

Obiettivi

La conoscenza delle metodologie statistiche per l'analisi della dinamica dei fenomeni economici nel tempo (serie storiche, indici temporali) e nello spazio (indici territoriali, indici di concentrazione).

Verranno anche studiati alcuni metodi previsionali ricorrenti in ambito economico e si considereranno alcuni criteri di valutazione delle previsioni. Nell'ultima parte del corso, tali tecniche vengono viste come strumenti per l'analisi tecnica dei mercati finanziari.

Risultati dell'apprendimento

Programma

1. I numeri indici:
 - a. indici semplici,
 - b. indici composti (Laspeyres, Paasche, Fisher, Divisia),
 - c. l'inflazione,
 - d. indici di comparazione territoriale: tassi di cambio nominali e tassi di cambio reali (comprensivi del diverso potere d'acquisto)
2. Analisi Classica delle Serie Storiche:
 - a. il trend di lungo periodo (teoria dell'interpolazione)
 - b. il ciclo-trend, (teoria delle medie-mobili)
 - c. la stagionalità (diverse tecniche di destagionalizzazione)
 - d. l'analisi dei residui
3. La concentrazione:
 - a. la curva di Lorenz
 - b. il rapporto di concentrazione di Gini
 - c. altri indici di concentrazione
4. I modelli previsionali:
 - a. Exponential Smoothing
 - b. I modelli di Holt-Winters
 - c. Criteri di valutazione delle previsioni
5. Elementi di Analisi Tecnica:
 - a. cenni sui mercati finanziari e sui cicli finanziari (movimento toro ed orso)
 - b. l'analisi grafica: trendline, principali figure
 - c. indicatori di tendenza: medie mobili semplici ed esponenziali, bande di Bollinger
 - d. indicatori di momento: ROC, MACD, RSI, VOI, OBV

Testi Consigliati

Guarini R. & Tassinari F. Statistica Economica. Ed. Il Mulino
Materiale didattico a cura del docente

Modalità Didattiche

Lezioni in aula con esercitazioni in aula multimediale.

I non frequentanti devono prendere preventivo contatto con il docente

Modalità di Esame

Esame scritto con esercizi di calcolo e domande teoriche

Note

Ai fini di una buona comprensione degli argomenti trattati, è essenziale aver superato un esame base di statistica.

Documento generato il 06.07.2010 - Per gli aggiornamenti si consiglia di consultare il portale di Facoltà <http://www.scipol.unito.it>