

STATISTICA ECONOMICA

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

PROGRAMMA D'ESAME A.A.: 2010-2011

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: tredline, 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

- Dispensa a cura del docente in Materiale Didattico
- Dispense presso la copisteria Copysprinter S.R.L. - Via delle Rosine, 4, Torino

- Guarini R., Tassinari F., Statistica Economica. Ed. Il Mulino
- Di Fonzo T., Lisi F., Serie Storiche Economiche. Carocci editore

Modalità Didattiche

Lezioni in aula con esercitazioni in aula multimediale.

Per i frequentanti le dispense e le lezioni dovrebbero essere sufficienti alla preparazione dell'esame. Per i non frequentanti potrebbe essere necessaria l'integrazione con i testi consigliati.

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 07.06.2011 - Per gli aggiornamenti si consiglia di consultare il portale di Facoltà <http://www.scipol.unito.it>