STATISTICA ECONOMICA

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

PROGRAMMA D'ESAME A.A.: 2012-2013
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'ultma parte del corso, tali tecniche vengono viste come strumenti per l'analisi tecnica dei mercati finanziari.

Risultati dell'apprendimento
Lo studente dovrà essere in grado di:
- calcolare indici temporali, semplici e complessi,
- stimare rapporti di parità di potere d'acquisto;
- determinare il grado di concentrazione di un fenomeno economico;
- scomporre una serie storica nelle componenti classiche (trend, ciclo, stagionalità,..)
- fare previsioni con opportuni modelli previsionali.

Dovrà inoltre dimostrare una formazione culturale-metodologica sugli strumenti d'utilizzo.
La verifica di tale preparazione avverrà secondo le modalità d'esame descritte oltre.

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'aquisto)

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 destagionalizzaione)
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. l'Exponential Smoothing
b. i modelli di Holt-Winters
c. criteri di valutazione delle previsioni

5. I modelli Autoregressivi
a. processi stocastici stazionari
b. processi e modelli Autoregressivi
c. previsioni con i modelli autoregressivi

Testi Consigliati
- Dispensa a cura del docente in Materiale Didattico

- 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 06.12.2012 - Per gli aggiornamenti si consiglia di consultare il portale di Facoltà http://www.scipol.unito.it