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

Anno di corso 1

Insegnamento in inglese TIME SERIES

Lingua ITALIANO

Settore disciplinare SECS-S/01

Percorso PERCORSO COMUNE

Corso di studi di riferimento Economia finanza e assicurazioni

Tipo corso di studi Laurea Magistrale

Sede Lecce

Crediti 8.0

Periodo Primo Semestre

Ripartizione oraria Ore Attività frontale: 64.0

Tipo esame Orale

Per immatricolati nel 2019/2020

Valutazione Voto Finale

Erogato nel 2019/2020

Orario dell'insegnamento https://easyroom.unisalento.it/Orario

BREVE DESCRIZIONE DEL CORSO	L'insegnamento di Analisi delle Serie Storiche fornisce agli studenti le basi teoriche per affrontare con rigore e metodo scientifico l'analisi di fenomeni temporali.
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). ***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.
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. Le nozioni acquisite conferiscono allo studente conoscenze e comprensione, capacità di applicare conoscenze e comprensione, autonomia di giudizio, abilità comunicative e capacità di apprendimento in linea con in descrittori di Dublino). **"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.** **"Per gli appelli in modalità telematica, l'esame si svolgerà oralmente con domande riguardanti aspetti teorici, esercizi e, laddove prevista, discussione di tesine preventivamente consegnate al docente."**
APPELLI D'ESAME	https://easytest.unisalento.it/Calendario/Dipartimento_di_Scienze_dellEconomia/

ALTRE INFORMAZIONI UTILI

-La frequenza alle lezioni, sebbene non sia obbligatoria, è vivamente consigliata.

-Gli studenti che si prenotano sul portale studenti.unisalento.it per sostenere la prova d'esame sono tenuti a verificare che la prenotazione sia andata a buon fine, mediante la stampa della ricevuta della prenotazione.
In caso di problematiche tecniche occorre segnalare il problema **almeno 7 giorni prima della data d'esame**.

-Le richieste di rinvio dell'esame, inviate per posta elettronica al docente, devono essere inoltrate entro e non oltre due giorni prima della data d'esame. In assenza di tale comunicazione, il rinvio può essere richiesto esclusivamente in sede d'esame. Si precisa inoltre che la richiesta di rinvio può essere reiterata al massimo per un anno accademico.

Commissione di esame:
De Iaco Sandra (presidente); Posa Donato (componente); Maggio Sabrina (componente); Palma Monica (componente), Pellegrino Daniela (componente); Claudia Cappello (componente); Giuseppina Giungato (componente).

Si comunica agli studenti iscritti ai CCdSS del Dipartimento di Scienze dell'Economia e che intendono sostenere l'esame in una delle Discipline Statistiche nella sessione d'esame 24 aprile-2 maggio 2020, **nonché nella sessione dal 25 al 30 maggio 2020 (sessione straordinaria riservata a Laureandi nella sessione di giugno e a Studenti Fuori Corso),** che l'esame si svolgerà eccezionalmente in via telematica ed in forma orale, seguendo le indicazioni previste dal DR 197/2020 e le relative linee guida pubblicate su www.unisalento.it redatte tenendo conto dell'attuale situazione di emergenza sanitaria.
Durante la stessa prova, saranno oggetto di valutazione le conoscenze e le competenze acquisite dallo studente su aspetti teorici ed applicativi connessi alla disciplina per la quale lo stesso studente si è prenotato a sostenere l'esame.

Gli studenti iscritti all'esame sono, pertanto, invitati a registrarsi (se non lo hanno già fatto) alla piattaforma Microsoft Teams, secondo le indicazioni pubblicate alla pagina https://www.unisalento.it/lezioni-online (Documentazione: Guida a Microsoft Teams per lo studente).

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".
- Metodi di analisi geostatistica per dati temporali ed areali (De Iaco, S.; Maggio, S.; Palma, M.; Posa, D.), 2018, Giappichelli editore, Torino, isbn 9788892119215.
- The Analysis of Time Series: An Introduction - C. Chatfield, Chapman & Hall/CRC Texts in Statistical Science, 330 p. (only the first 5 chapters).