

<b>Codice</b>	27003218
<b>Denominazione Attività Formativa</b>	<b>TECNICHE STATISTICHE AVANZATE</b>
<b>Ambito</b>	Statistico
<b>Tipo Insegnamento</b>	OB - caratterizzante
<b>CFU</b>	10
<b>Anno Corso</b>	I
<b>Periodo Didattico</b>	annuale
<b>Ore</b>	60

*Modulo a)*

<b>Codice</b>	27003120
<b>Descrizione</b>	<b>SERIE STORICHE</b>
<b>Codice Settore</b>	SECS-S/01
<b>Ambito</b>	Statistico
<b>Tipo Insegnamento</b>	OB - Caratterizzante
<b>CFU</b>	5
<b>Anno Corso</b>	I
<b>Periodo Didattico</b>	3° (23/02/2015 – 11/04/2015)
<b>DOCENTE</b>	<b>TARSITANO Agostino</b>
<b>Codice Ruolo /ID</b>	PA / 002138
<b>Tipo Attività</b>	LEZ
<b>Ore</b>	30
<b>Tirocinio</b>	NO
<b>Lingua di insegnamento</b>	Italiano
<b>Contenuti</b>	1) Operazioni preliminari: correzioni di calendario, valori mancanti, valori anomali, trasformazioni 2) Processi stocastici: stazionarietà ed ergodicità, autocorrelazioni. 3) Modelli lineari per processi stocastici; modelli ARMA ed ARIMA: proprietà, identificazione, stima, controllo diagnostico. 4) Modelli SARIMA 5) Modelli Reg-ARIMA 6) Cenni di cluster analysis delle serie storiche
<b>Testi di riferimento</b>	Testi: dispense fornite dal docente. Di Fonzo T., Lisi F. (2005), Serie storiche economiche: analisi statistiche e applicazioni, Carocci Piccolo D. (1990), Introduzione all'analisi delle serie storiche, Carocci Santamaria L. (2000), Analisi statistica delle serie storiche economiche, Carocci
<b>Obiettivi formativi</b>	Nel approfonditi i temi riguardanti l'analisi statistica delle serie storiche secondo l'approccio Box-Jenkins con particolare riferimento alle serie storiche economiche e dei fenomeni finanziari: variabili macroeconomiche tassi di cambio, tassi di interesse, prezzi e rendimenti azionari, prezzi e rendimenti di titoli derivati.

[0752] Corso di Laurea Magistrale in Statistica e Informatica per l'Azienda e la Finanza  
– curriculum SFA (Statistica, Finanza ed Assicurazioni) -  
SCHEDA INSEGNAMENTO a.a.2014-2015

<b>Prerequisiti</b>	buone conoscenze dell'ambiente R, inferenza statistica, serie storiche (approccio classico)
<b>Metodi didattici</b>	Il corso tratta i contenuti metodologici ed applicativi direttamente in laboratorio con il linguaggio R. Competenza teorico-pratica nel trattamento delle serie storiche. Capacità di consulenza e di intervento.
<b>Altre informazioni</b>	Unità formative opzionali consigliate. Statistica economica Pagina Docente: <a href="http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/cozzucoli/">http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/cozzucoli/</a>
<b>Modalità di verifica dell'apprendimento</b>	Esami intermedi teorico-pratici. Esame scritto sulle nozioni teoriche impartite. Discussione del progetto di analisi di una serie storica.

*Modulo b)*

<b>Codice</b>	27003121
<b>Descrizione</b>	<b>MODELLI LINEARI GENERALIZZATI</b>
<b>Codice Settore</b>	SECS-S/01
<b>Ambito</b>	Statistico
<b>Tipo Insegnamento</b>	OB - Caratterizzante
<b>CFU</b>	5
<b>Anno Corso</b>	I
<b>Periodo Didattico</b>	4° (13/04/2015 – 30/05/2015)
<b>DOCENTE</b>	<b>DOMMA Filippo</b>
<b>Codice Ruolo /ID</b>	PO / 002336
<b>Tipo Attività</b>	LEZ
<b>Ore</b>	30
<b>Tirocinio</b>	NO
<b>Lingua di insegnamento</b>	Italiano
<b>Contenuti</b>	Nel corso vengono forniti gli strumenti necessari per la costruzione di modelli statistici per l'analisi di dati quantitativi e qualitativi, usualmente presenti nelle scienze economiche e sociali, descritti da un'unica e generale struttura metodologica denominata "Modelli Lineari Generalizzati". In particolare, verranno descritti i modelli per variabili dipendenti quantitative (gaussiana e non), modelli di regressione per dati binari (regressione logistica e modelli probit), modelli per dati conteggio (regressione di Poisson) e modelli per dati di sopravvivenza.
<b>Testi di riferimento</b>	McCullagh P. Nelder J.A. (1989) "Generalized Linear Models", Chapman and Hall; J.K. Lindsey (1997): "Applying Generalized Linear Models", Springer; Hosmer D. Lemeshow S. (2000) "Applied Logistic Regression", Wiley. Hosmer, D., Lemeshow, S., and May, S. (2008), Applied Survival Analysis: Regression Modeling of Time-to-Event Data, Second Edition, John Wiley & Sons; Piet de Jong and Gillian Z. Heller (2008): "Generalized Linear Models for Insurance data", Cambridge University

[0752] Corso di Laurea Magistrale in Statistica e Informatica per l'Azienda e la Finanza  
– curriculum SFA (Statistica, Finanza ed Assicurazioni) -  
SCHEDA INSEGNAMENTO a.a.2014-2015

	Press.
<b>Obiettivi formativi</b>	L'obiettivo principale del corso è quello di fornire gli elementi necessari per la costruzione e l'utilizzazione di una ampia classe di modelli statistici denominata Modelli Lineari Generalizzati in presenza di variabili quantitative e qualitative, prestando attenzione ai contesti applicativi.
<b>Prerequisiti</b>	Elementi di calcolo delle probabilità, inferenza statistica (stima puntuale, intervallica di confidenza e test d'ipotesi); regressione multipla. Algebra delle matrici. Modulo SERIE STORICHE
<b>Metodi didattici</b>	lezioni teoriche e analisi di un set di dati
<b>Altre informazioni</b>	Pagina <span style="float: right;">Docente:</span> <a href="http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/domma/">http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/domma/</a>
<b>Modalità di verifica dell'apprendimento</b>	esame orale e preparazione di una breve dissertazione