UNIVERSITA' DELLA CALABRIA

Facoltà di Economia
Corso di laurea in ***Metodi Quantitativi per l'Economia e la Gestione delle Aziende***
Corso di laurea Specialistica in ***Statistica e Informatica per l'Economia e la Finanza***

Programma dell'insegnamento di

METODI PROBABILISTICI PER L' ECONOMIA

Corso di Laurea in Metodi Quantitativi per l'Economia e la Gestione delle Aziende
A.A. 2008-09

Disciplina	Metodi Probabilistici per l' Economia
Settore Disciplinare	SECS-S/06
Obiettivi Formativi	Fornire gli elementi di base del calcolo delle probabilità sufficienti per affrontare lo studio di fondamentali applicazioni in ambito economico-finanziario
Numero crediti	5
Propedeuticità	Statistica e Calcolo delle Probabilità
Modalità di svolgimento del corso	Lezioni frontali
Modalità di svolgimento dell'esame e valutazione	In forma scritta (redazione di una tesina) ed orale. Trentesimi
Contenuti	-La funzione generatrice dei momenti per variabili aleatorie notevoli unidimensionali discrete (binomiale, geometrica,binomiale negativa,Poisson, uniforme), assolutamente continue (uniforme, esponenziale negativa,normale) e trasformazioni affini di esse. -Variabili aleatorie multiple: somma e prodotto di variabili aleatorie doppie indipendenti. La funzione generatrice dei momenti per la somma di variabili aleatorie indipendenti -La disuguaglianza di Chebyshev -Processi stocastici discreti a parametro discreto (definizione e primi esempi) - Sulla nozione di convergenza. Legge forte e legge debole dei grandi numeri. Teorema del limite centrale.

UNIVERSITA' DELLA CALABRIA

Facoltà di Economia

Corso di laurea in ***Metodi Quantitativi per l'Economia e la Gestione delle Aziende***

Corso di laurea Specialistica in ***Statistica e Informatica per l'Economia e la Finanza***

Bibliografia d'esame	Daboni, L.: calcolo delle probabilità ed elementi di statistica. (Capitoli IV, V, VI, VII, VIII) Ovvero qualsiasi altro testo universitario di calcolo delle probabilità, quali ad esempio: Cifarelli, D.M.: introduzione al calcolo delle probabilità Baldi, P.: calcolo delle probabilità e statistica