



**Corso di Laurea magistrale in
Statistica e Informatica per
l'Azienda e la Finanza
a.a. 2010-11**

Denominazione dell'insegnamento in inglese: <i>Statistical Methods for risk analysis</i>	
Ambito disciplinare: Statistico	
Tipologia di attività formativa: Statistica	
SSD (settore scientifico disciplinare): SECS-S/01	
Crediti Formativi (CFU): 10	
Ore di lezione in Aula: 60	Ore riservate allo studio individuale: 190
Docente Responsabile: Rosaria Romano	
Lingua d'insegnamento: Italiano	
Anno di corso: II	
Propedeuticità: <i>Statistica per i Mercati Finanziari</i>	
Organizzazione della Didattica: lezioni frontali ed utilizzo di software specifico in laboratorio	
Modalità di frequenza: obbligatoria	Modalità di erogazione: tradizionale
Metodi di valutazione: scritto e orale	
Risultati di apprendimento previsti: Lo studente dovrà acquisire le competenze necessarie all'utilizzo della metodologia statistica per la misura, la gestione e il controllo delle principali fonti di rischio in cui si imbattono le società finanziarie o, più in generale, gli agenti economici. Il corso è principalmente strutturato in tre moduli di insegnamenti relativi, rispettivamente, al rischio di credito, al rischio finanziario e a quello operativo.	
Programma/contenuti: Il corso intende fornire allo studente conoscenze sulle tecniche statistiche per l'analisi e la previsione del rischio di insolvenza. Dopo una introduzione al credit scoring verranno approfondite alcune tecniche statistiche maggiormente diffuse in tale contesto: Analisi Discriminante, Alberi di Classificazione, Regressione Logistica. Lo studio di alcuni casi applicativi verrà realizzato utilizzando software specifico.	
Bibliografia Elenco testi suggeriti: Introduzione ai metodi statistici per il credit scoring, Stanghellini, Springer. Appunti di analisi dei dati multidimensionali, Gherghi e Lauro, Curto editore. Classification and Regression Tree, Breiman et al., Wadsworth.	

Codifica GISS: