

Serie Storiche

Prof. Agostino Tarsitano

Corso di Laurea Specialistica in Statistica e Informatica per l'Economia e
l'Impresa

Disciplina	Serie storiche
Settore Disciplinare	Secs-S/01
Obiettivi Formativi	Questo modulo fornirà le competenze teoriche e pratiche per modellare le serie storiche e per utilizzare i modelli a fini previsivi
Numero crediti	5
Propedeuticità	Statistica economica. Modulo 2
Modalità di svolgimento del corso	Nell'ambito del laboratorio statistico ed in ambiente R
Modalità di svolgimento dell'esame e valutazione	Colloquio orale su realizzazione progetto di ricerca
Contenuti	Le serie storiche si incontrano in molti contesti scientifici e professionali. Ad esempio nel monitoraggio di indicatori economici ed aziendali, nel controllo dell'ambiente, nella farmacologia. La caratteristica comune di questo tipo di dati è la dipendenza tra valori successive. L'analisi delle serie storiche ha come scopo la scoperta, la negazione, la descrizione di questo legame. Dopo una brevissima panoramica sull'approccio classico si passerà ai processi stocastici ed ai modelli Box-Jenkins ARIMA e SARIMA. Infine saranno discussi i processi VAR.
Bibliografia d'esame	Indicati nelle prime lezioni