

**STATISTICA ECONOMICA**

*Prof.ssa Luisa Scaccia*

12 crediti

**Programma del corso:**

1. Richiami di Calcolo delle Probabilità e Teoria delle Variabili Casuali
2. Il Modello di Regressione Semplice
3. Il Modello di Regressione Multipla
4. La previsione per dati temporali
5. Le Medie Mobili
6. Il liscio esponenziale singolo e doppio
7. Approccio classico all'analisi delle serie storiche: Trend, Ciclo e Stagionalità
8. L'approccio moderno all'analisi delle serie storiche – Processi Stocastici
9. Momenti dei processi stocastici
10. Modelli ARMA(p,q)
11. La procedura di Box e Jenkins per l'identificazione del Modello
12. La previsione con i modelli ARMA

**Ampliamento delle conoscenze:**

Le esercitazioni in laboratorio presuppongono inoltre familiarità con l'ambiente Windows e con alcuni dei programmi del pacchetto Microsoft Office, in particolare Word ed Excel.

**Requisiti indispensabili di conoscenze per proficua fruizione del corso:**

Matematica generale

Statistica

**Testi consigliati e programma di esame:**

- D.M. LEVINE, T.C. KREHBIEL, M.L. BERENSON, *Statistica*, Apogeo.  
Cap. 12, Cap. 13 (disponibile on line).
- T. DI FONZO, F. LISI (2000), *Complementi di Statistica Economica, Analisi delle serie storiche univariate*, CLEUP.

**Modalità dell'esame:** Orale.