

CLM 56 Management, Finanza e Sviluppo

Modelli Statistici per la Finanza

(Prof. Gattone)

Programma 1° modulo

1. Richiami di statistica inferenziale
2. Modello di regressione lineare multipla
 - a) Stima
 - b) Inferenza: verifica d'ipotesi, intervalli di confidenza e test F
 - c) Diagnostica nel modello di regressione
 - d) Regressione con variabili dummy e interazione

Materiale didattico

L'analisi della regressione è presente in quasi tutti i testi di Statistica di base. Si suggeriscono, ad esempio:

- D. M. Levine, T. C. Krehbiel, M. L. Berenson (2011), **Statistica**, Apogeo
- S. Borra, A. Di Ciaccio (2015), **Statistica**, McGraw-Hill
- G. Cicchitelli (2012), **Statistica – Principi e Metodi**, Pearson

3. Introduzione all'analisi delle serie storiche: approccio classico
 - a) Componenti delle serie storiche: trend, ciclo, stagionalità
 - b) Analisi del trend mediante funzioni matematiche
 - c) Stagionalità
4. Introduzione all'analisi delle serie storiche: approccio moderno
 - a) Processi stocastici: caratteristiche generali
 - b) La funzione di autocorrelazione globale e parziale
 - c) Modelli AR, MA, ARMA: caratteristiche e proprietà

Materiale didattico

- Di Fonzo, T., Lisi F. (2012), *Serie storiche economiche*, Carocci.
- Dispense del corso

E' prevista una prova scritta al termine del primo modulo.