



Insegnamento: SERIE STORICHE			
Codifica: 50903073		SSD (settore scientifico disciplinare): SECS-S/01	
Docente Responsabile: Agostino Tarsitano			
Crediti Formativi (CFU): 5			
Ore di lezione	40	Ore riservate allo studio individuale	85
Il corso/i di studio, per i quali lo stesso costituisce un'attività di base o caratterizzante: Laurea Specialistica in Statistica e Informatica per l'Economia e la Finanza (SIEF)			
Lingua d'insegnamento: Italiano 			
Anno di corso: secondo			
Propedeuticità: Statistica Economica. Modulo 2			
Organizzazione della Didattica: Nell'ambito del laboratorio statistico ed in ambiente R			
Modalità di frequenza: obbligatoria			
Modalità di erogazione: tradizionale			
Metodi di valutazione: Colloquio orale su realizzazione progetto di ricerca			
Risultati di apprendimento attesi: Questo modulo fornirà le competenze teoriche e pratiche per modellare le serie storiche e per utilizzare i modelli a fini previsivi			
Programma/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.			
Date di inizio e termine e il calendario delle attività didattiche: 09/12/2008 – 07/02/2009 per il calendario delle attività didattiche: www.economia.unical.it			
Il calendario delle prove di esame: Le date degli appelli d'esame vengono fissate e rese pubbliche sul sistema UNIWEX (http://didattica.unical.it) in accordo a quanto previsto dal Calendario Accademico 2008-2009 della Facoltà di Economia che prevede le seguenti sessioni d'esame: I sessione (17/11/2008-06/12/2008) – un appello; II sessione (09/02/2009-07/03/2009) – due appelli;			



III sessione (27/04/2009-16/05/2009) – un appello;

IV sessione (06/07/2009-31/07/2009) – due appelli;

V sessione (31/08/2009-26/09/2009) – un appello.

Bibliografia

Le indicazioni sulla bibliografia verranno date nelle prime lezioni