

UNIVERSITÀ DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

SYLLABUS DEL CORSO

Analisi Esplorativa

2021-2-E4102B084-E4102B084M

Obiettivi formativi

Il modulo di Analisi Esplorativa introduce i principali metodi statistici descrittivi per lo studio di due o più fenomeni osservabili congiuntamente su un insieme di unità statistiche. Si tratta di metodi finalizzati all'esplorazione dei dati multivariati per individuarne la struttura soggiacente e ridurne la dimensionalità in modo da preservare le caratteristiche principali osservate. Dal punto di vista applicativo l'analisi dei dati viene affrontata con il ricorso al software R in ambiente RStudio.

Conoscenza e comprensione. Questo insegnamento fornirà conoscenze e capacità di comprensione relativamente a:

- Principali metodologie esplorative di base dell'analisi statistica multivariata finalizzate al problema della classificazione delle unità statistiche e alla sintesi delle variabili osservate in un numero ridotto di indicatori
- Applicazione dei metodi nella pratica mediante esercizi numerici svolti con la calcolatrice (ossia, senza l'ausilio del software statistico)
- Logica e funzionamento alla base del linguaggio R e suo utilizzo nell'ambito dell'applicazione delle principali analisi statistiche per dati multidimensionali e delle relative rappresentazioni grafiche
- Lettura e interpretazione degli output delle analisi prodotte con R.

Capacità di applicare conoscenza e comprensione. Alla fine dell'insegnamento gli studenti saranno in grado di:

- Scegliere le metodologie esplorative di base dell'analisi statistica multivariata più adeguate in base agli scopi delle analisi e alla natura dei dati a disposizione
- Ridurre la dimensionalità di un dataset aggregando le unità statistiche in gruppi e/o costruendo indicatori di sintesi delle variabili osservate
- Interpretare e confrontare i risultati delle analisi ottenute con metodi diversi per stabilire quale approccio sia

- da ritenersi più opportuno in base a specifici criteri fissati a priori
- Importare in R file di dati esterni di varia provenienza e formato e utilizzare in modo autonomo la sintassi di base del linguaggio R.

L'insegnamento consente allo studente di acquisire solide basi teoriche e applicative relativamente ai principali metodi esplorativi dell'analisi di dati multidimensionali necessarie in qualsiasi contesto lavorativo in cui si utilizzino file di dati e che rappresentano una base imprescindibile per il proseguimento del percorso universitario.

Contenuti sintetici

Introduzione all'analisi statistica multivariata, matrici di dati quantitativi, qualitativi e misti, rappresentazioni grafiche per dati multidimensionali. Cluster Analysis: metodi di raggruppamento gerarchici e non gerarchici. Analisi delle componenti principali. Analisi discriminante lineare. Uso integrato dei metodi esplorativi di analisi multivariata. Applicazioni a dati reali con il software R in ambiente RStudio.

Programma esteso

- Introduzione all'analisi statistica multivariata: scuola francese e scuola anglosassone, classificazione delle metodologie di analisi multivariata
- Matrici di dati quantitativi, qualitativi e misti. Principali sintesi e trasformazioni. Rappresentazione dei dati, spazio degli individui e spazio delle variabili. Dissimilarità e distanze fra unità, distanze fra variabili
- Cluster Analysis: metodi di raggruppamento gerarchici e non gerarchici, bontà della classificazione, applicazione a variabili quantitative e qualitative
- Analisi delle componenti principali: estrazione delle componenti principali, criteri di arresto, valutazione della variabilità riprodotta, interpretazione delle componenti principali, applicazioni
- Analisi discriminante lineare: determinazione delle funzioni discriminanti lineari nel caso di due o più popolazioni, metodo alternativo per ricavare le funzioni discriminanti, regole decisionali e valutazione dei risultati, applicazioni
- Uso integrato delle tecniche esplorative di analisi multivariata
- Analisi di casi empirici con RStudio

Prerequisiti

Superamento degli esami degli insegnamenti propedeutici di I anno: Statistica I, Analisi Matematica I, Algebra Lineare, Calcolo delle Probabilità

Metodi didattici

Lezioni teoriche in aula ed esercitazioni pratiche in laboratorio statistico-informatico con il software R in ambiente RStudio.

Nel periodo di emergenza Covid-19 le lezioni si svolgeranno in modalità da remoto asincrono (lezioni videoregistrate caricate sulla pagina e-learning del corso in base al calendario ufficiale delle lezioni) con incontri periodici in videoconferenza (o in presenza fisica se autorizzati dall'Ateneo).

Modalità di verifica dell'apprendimento

L'esame	consiste	in una	prova	scritta	(durata	comp	lessiva	: 2 or	e) con	tre	quesiti	(artico	lati i	n più	punti)	che
riguardar	no gli asp	etti sia	teorici	sia app	olicativi	delle	metodo	ologie	trattate	dur	ante il	corso.	Un d	quarto	quesi	ito è
facoltativ	o e riguar	da la pr	ogramn	nazione	e con il :	softwa	re R	na antina apuntana yi mputa tura dingga da yi yapunini								or III a constitute d'author se aparte

La prova	orale e	racoltat	ıva (su	ricniesta	a dei dod	cente	e o dello stu	idente)	i e riguarda	ı argome	nti sia	a teorici sia	pratici.
L'accesso	alla pr	ova ora	le è sub	oordinat	o al sup	eram	nento della	prova	scritta con	un esito	di alr	meno 18/30). Si fa
presente	che la	prova	orale p	ouò con	nportare	sia	l'aumento,	sia il	mantenim	ento, ch	e la	diminuzion	e della
valutazior	ne cons	eguita a	lla prov	a scritta									

Testi di riferimento

- Materiale didattico della docente pubblicato sul sito e-learning del corso (ad accesso riservato con password)
- Frosini, B.V. (2014). Complementi di analisi statistica multivariata, EDUCatt, Milano
- Zani, S., Cerioli, A. (2007). Analisi dei dati e data mining per le decisioni aziendali, Giuffrè Editore, Milano
- Gherghi, M., Lauro, C. (2004). Appunti di analisi dei dati multidimensionali. Metodologia ed esempi, RCE Edizioni, Napoli
- Bolasco, S. (1999). Analisi multidimensionale dei dati: strategie e criteri di interpretazione, Carocci, Roma
- Dillon, W.R., Goldstein, M. (1984). Multivariate Analysis, J. Wiley, New York
- Everitt, B.S., Hothorn, T. (2011). An Introduction to Applied Multivariate Analysis with R, Springer, Berlin

Periodo di erogazione dell'insegnamento

I Semestre, II ciclo

Lingua di insegnamento

Italiano