UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

SYLLABUS DEL CORSO

Analisi Esplorativa

2122-2-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.

Modalità di verifica dell'apprendimento

L'esame consiste in una prova scritta (durata complessiva: 2 ore) con tre quesiti (articolati in più punti) che riguardano gli aspetti sia teorici sia applicativi delle metodologie trattate durante il corso. Un quarto quesito è facoltativo e riguarda la programmazione con il software R. Le domande a natura teorica riguardano gli aspetti metodologici degli argomenti trattati al corso e consentono di verificare le conoscenze teoriche acquisite in merito alle nozioni di base dell'analisi statistica multivariata (in particolare, principali matrici e loro proprietà, principali tipologie di dati) e alle metodologie di analisi dei gruppi, analisi delle componenti principali e analisi discriminante lineare. Le domande a natura applicativa riguardano sia esercizi numerici (da svolgere con la calcolatrice), sia la lettura e il commento di parti di output di R, e consentono di verificare le capacità di comprensione e di applicazione della teoria, di calcolo, di interpretazione e commento dei risultati e di scelta fra analisi ottenute con opzioni diverse dei metodi. Inoltre, l'esame in forma scritta permette complessivamente di verificare la capacità di espressione mediante utilizzo adeguato del linguaggio tecnico statistico.

La prova orale è facoltativa (su richiesta del docente o dello studente) e riguarda argomenti sia teorici sia pratici. L’accesso alla prova orale è subordinato al superamento della prova scritta con un esito di almeno 18/30. Si fa presente che la prova orale può comportare sia l'aumento, sia il mantenimento, che la diminuzione della valutazione conseguita alla prova scritta.

Considerata l'abbondanza di materiale didattico messo a disposizione dalla docente sulla piattaforma e-learning del corso, non si prevede alcuna distinzione fra esami per studenti frequentanti ed esami per studenti non frequentanti. Infine non si prevedono prove in itinere.

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 periodo

Lingua di insegnamento

Italiano