



UNIVERSITÀ DI PISA

MODELLI PROBABILISTICI PER LE DECISIONI ECONOMICHE ED AZIENDALI

RACHELE FOSCHI

Anno accademico

2018/19

CdS

ECONOMIA E COMMERCIO

Codice

065PP

CFU

6

Moduli	Settore/i	Tipo	Ore	Docente/i
MODELLI PROBABILISTICI PER LE DECISIONI ECONOMICHE ED AZIENDALI	SECS-S/06	LEZIONI	42	RACHELE FOSCHI

Obiettivi di apprendimento

Conoscenze

Il corso si propone di fornire le conoscenze di base in ambito probabilistico e le tecniche di calcolo più idonee ad affrontare in modo adeguato alcuni problemi economici in condizioni di incertezza, problemi aziendali di gestione delle scorte, problemi logistici di gestione dei flussi di lavoro, problemi di scelta nell'ambito delle decisioni aziendali. Durante il corso saranno svolte delle lezioni nell'aula informatica mirate a fornire le conoscenze di base per l'utilizzo del software per il calcolo matriciale Matlab.

Modalità di verifica delle conoscenze

Le conoscenze dello studente saranno verificate mediante lo svolgimento di una prova scritta.

Capacità

Alla fine del corso, lo studente dovrà acquisire una buona padronanza degli strumenti matematici e probabilistici presentati nel corso. Tale competenza sarà di ausilio nella formalizzazione e nella comprensione degli aspetti matematici e probabilistici sottostanti vari modelli economici e di gestione aziendale.

Modalità di verifica delle capacità

Durante la prova scritta, lo studente dovrà risolvere con accuratezza gli esercizi. La capacità di mettere in relazione gli aspetti teorici necessari per la formalizzazione del problema e per la successiva risoluzione dell'esercizio sarà oggetto di specifica valutazione.

Comportamenti

Alla fine del corso, lo studente vedrà ampliate le sue abilità nel comprendere, formalizzare e risolvere un problema secondo il linguaggio ed il rigore propri della matematica e i metodi specifici della probabilità.

Modalità di verifica dei comportamenti

Durante l'esame, lo studente dovrà dimostrare le sue capacità di applicare i concetti matematici che ha appreso nel corso.

Prerequisiti (conoscenze iniziali)

Funzioni di una variabile reale.
Algebra lineare.



UNIVERSITÀ DI PISA

Indicazioni metodologiche

Metodo di insegnamento: lezioni frontali (fortemente consigliate). Attività per l'apprendimento: frequenza alle lezioni, studio individuale

Programma (contenuti dell'insegnamento)

- 1) Breve ripasso degli strumenti di base del calcolo delle probabilità.
- 2) Catene di Markov a stati finiti: processi stocastici con la proprietà di mancanza di memoria e loro rappresentazione a stati tramite la matrice di transizione. Stati transitori, stati ricorrenti, tempi medi di ritorno, costi attesi di medio periodo. Distribuzioni stazionarie e probabilità di assorbimento. Proprietà di lungo periodo. Applicazioni delle Catene di Markov a problemi economici ed a problemi aziendali di gestione delle scorte.
- 3) Decisioni sequenziali: grafi ed alberi delle decisioni, decisioni in condizioni di incertezza, utilità e disutilità attese, metodo risolutivo della "backward induction".
- 4) Teoria delle code: tempi medi di arrivo e di servizio, code con una e più unità serventi. Lunghezza media della coda, tempi medi di attesa, e loro rapporto con l'incertezza degli arrivi e dei servizi. Formule risolutive principali e loro uso nello studio dei problemi logistici e della progettazione di sistemi di gestione dei flussi di lavoro.

Bibliografia e materiale didattico

- a) Per l'Esame: Durante il corso verranno distribuiti degli appunti del docente
- b) per la consultazione:
 - Hillier-Lieberman, Introd. alla Ricerca Operativa, 1992. (Cap. 3-10-11-12-13).
 - Aliprantis, Games and Decision Making, 2000. (Cap. 3 e 4)
 - Gordon et al, Quantitative Decision Making for Business, 1990.
 - Taylor, Introduction to Management Science, 1996

Modalità d'esame

L'esame consiste in una prova scritta della durata di 3 ore in cui è richiesto lo svolgimento di esercizi sugli argomenti del corso.

La prova scritta è sufficiente se lo studente raggiunge un punteggio minimo di 18.

Ultimo aggiornamento 29/11/2018 12:46