

Modul	STATISTIKA
Semestar	2
ESPB	10

[ANALIZA VREMENSKIH SERIJA 1 D]

INFOPAKET

1. Sadržaj predmeta

Oblast: Statistika i matematika (ekonometrija)

Neophodno predznanje: položen bar jedan predmet iz ekonometrije i bar jedan predmet iz analize vremenskih serija.

2. Program predmeta

Izborni predmet

Osnovne teme:

Modeli vremenskih serija sa jediničnim korenom i nelinearni modeli vremenskih serija.

Nastava se realizuje kroz časove predavanja i studijsko istraživački rad.

3. Literatura

Obavezna

- Hamilton, J.D., Time Series Analysis, Princeton University Press, 1994.
- Terasvirta, T., Tjostheim, D. and Granger C.W.J., Modelling Nonlinear Economic Time Series, Oxford University Press, 2010.
- Tsay, R.S. and Chen R., Nonlinear Time Series Analysis, Wiley, 2019.

4. Način polaganja ispita

Ispit se polaže pismeno odgovaranjem na pitanja otvorenog tipa.

5. Nastavnici i kontakti

Zorica Mladenović, zorica.mladenovic@ekof.bg.ac.rs