

Modul	EKONOMIJA
Semestar	2
ESPB	10

[MAKROEKONOMETRIJA 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:

Kointegraciona analiza u okviru vektorskog autoregresionog (VAR) modela. Strukturni VAR modeli. Različiti pristupi u definisanju strukturnih odnosa.

Nastava se realizuje na osnovu časova predavanja i vežbi u RC.

3. Literatura

Obavezna

- Enders, W., Applied Econometric Time Series, Wiley, 2015, 4th ed.
- Juselius, K., The Cointegrated VAR Model: Methodology and Applications, Oxford University Press, 2006.
- Kilian, L. and Lutkepohl, H., Structural Vector Autoregressive Analysis, Cambridge University Press, 2017.

Preporučena

Oularis, S., Pagan, A., and Restrepo, J., Quantitative Macroeconomic Modeling with Structural Vector Autoregressions – An EViews Implementation, 2016,
<https://www.eviews.com/StructVAR/structvar.pdf>

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