

**Табела 5.2. Спецификација предмета**  
Спецификацију треба дати за сваки предмет из студијског програма.

<b>Студијски програм:</b> Основне академске студије МАТЕМАТИКА			
<b>Назив предмета:</b> Временске серије и примене у финансијама			
<b>Наставник/наставници:</b> Јелена Јоцковић			
<b>Статус предмета:</b> обавезни			
<b>Број ЕСПБ:</b> 6			
<b>Услов:</b> Увод у вероватноћу, Случајни процеси			
<b>Циљ предмета:</b> Стицање општих и специфичних знања из области анализе временских серија.			
<b>Исход предмета:</b>			
<b>Садржај предмета</b>			
<i>Теоријска настава</i>			
Описивање временске серије. Издвајање и елиминација неслучајних компоненти временске серије. Стационарне временске серије. Линеарни процес. ARMA модели. Парцијална корелација. Оцењивање параметара. Прогнозирање стационарних временских серија. ARIMA модели. Избор модела. Модели нестабилне варијансе. Серије са јединичним кореном. Структурни лом. Вишедиомензионе временске серије. VAR модели. Узрочност и коинтеграција.			
<i>Практична настава</i>			
<b>Литература:</b>			
1. Зорица Младеновић, Александра Нојковић, Примењена анализа временских серија, Центар за издавачку делатност Економског факултета у Београду, 2012.			
2. Јован Малишић, Весна Јевремовић, Случајни процеси и временске серије, Математички факултет, Београд, 2008.			
3. James D. Hamilton, Time Series Analysis, Princeton University Press, 1994.			
<b>Број часова активне наставе:</b> 5		<b>Теоријска настава:</b> 3	<b>Практична настава:</b> 2
<b>Методе извођења наставе:</b> фронтални, групни и практични.			
<b>Оцена знања (максимални број поена 100)</b>			
<b>Предиспитне обавезе</b>	поена	<b>Завршни испит</b>	поена
активност у току предавања		писмени испит	
практична настава		усмени испит	40
колоквијум-и	60	.....	
семинар-и			
Начин провере знања могу бити различити наведено у табели су само неке опције: (писмени испити, усмени испит, презентација пројекта, семинари итд.....			
*максимална дужина 2 странице А4 формата			