

Студијски програм: Докторска школа математике, докторске академске студије			
Предмет: Анализа временских серија			
Наставник: Мирослав М. Ристић			
Тип предмета: обавезни			
ЕСПБ бодова: 10			
Услови: -			
Циљ курса: Упознавање са анализом временских серија.			
Исходи: Студент ће овладати идентификацијом и истраживањима временских низова, проценом непознатих параметара, и конструисањем нових модела временских низова.			
Course description (outline): Стационарни временски низови. Стационарност и строга стационарност. Аутоковаријантне функције. Стационарни АРМА модели. Предикција. Процена непознатих параметара. Мултиваријациони временски низови. Мултиваријациони АРМА модели. Временски низови са случајним коефицијентима. Минификација временских низова. Целоброно вредности ауторегресивни временски низови.			
References: 1. Brockwell, P.J., Davis, R.A., Time series: Theory and Methods, Springer-Verlag, New York, 1987. 2. Kedem, B., Fokianos, K., Regression Models for Time Series Analysis, John Wiley & Sons, 2005.			
Активни часови наставе	Теоријска настава: 4		Практична настава:
Методе наставе: Предавања и вежбање, са активним учешћем студента, дискусије, семинари.			
Структура оцењивања			
Предиспитне обавезе	Поена	Испит	Поена
Колоквијуми	25	Усмени испит	50
Семирарски радови	25		