

Назив предмета: Анализа временских низова		
Наставник: Мирослав Ристић		
Статус предмета: Изборни		
Број ЕСПБ: 12		
Услов: -		
Циљ предмета		
Упознавање са основним и главним појмовима и методама анализе временских низова.		
Исход предмета		
Макро и микро анализа проблема анализе временских низова, као и успешна примена метода анализе временских низова у даљим научним истраживањима		
Садржај предмета		
<i>Теоријска настава</i>		
Стационарни временски низови. Стационарност и строга стационарност. Аутоковаријансна функција стационарног временског низа. Стационарни АРМА процеси. Прогноза стационарних процеса. Оцењивање непознатих параметара АРМА процеса. Вишедимензионални временски низови. Вишедимензионални АРМА процеси. Ауторегресивни процеси са случајним коефицијентима. Минификациони процеси. Временски низови са целобројним вредностима.		
<i>Практична настава</i>		
Дефинисање и решавање проблема у вези са теоријском наставом, израда одговарајућих задатака на рачунару расположивим статистичким пакетима, студијски истраживачки рад.		
Препоручена литература		
1. Brockwell, P.J., Davis, R.A., Time series: Theory and Methods, Springer-Verlag, New York, 1987. 2. Kadem, B., Fokianos, K., Regression Models for Time Series Analysis, John Wiley & Sons, 2005. 3. Wei, W.S., Time series analysis: univariate and multivariate methods, Pearson Addison Wesley, 2006. 4. Fuller, W.A., Introduction to statistical time series, John Wiley & Sons, 2009.		
Број часова активне наставе	Теоријска настава: 4	Практична настава:
Методе извођења наставе		
Метода усменог излагања, метода разговора, метода примене програмских пакета.		
Оцена знања (максимални број поена 100)		
50 предиспитне обавезе, 50 испит		
Начин провере знања могу бити различити : (писмени испити, усмени испт, презентација пројекта, семинари итд.) семинарски радови, домаћи задаци - предиспитне обавезе, усмени испит		

