

Професор Зорица Младеновић
Докторске студије Економског факултета у Београду
Економетрија 1Д – Анализа временских серија
Школска година 2023/24.

План рада за студенте који су ЗАВРШИЛИ МАСТЕР Економетрија на Економском факултету или су у претходном школовању изучавали једнодимензионе и вишедимензионе моделе временских серија

I Основна литература

Davidson and MacKinnon (2021), *Econometric Theory and Methods*, Oxford University Press,
<http://qed.econ.queensu.ca/ETM/>

1. Метод уопштених момената

Davidson and MacKinnon (2021), глава 9. Задаци: 9.5, 9.18, 9.22.

2. Метод максималне веродостојности

Davidson and MacKinnon (2021), глава 10. Задаци: 10.11, 10.13

3. Методе анализе стационарних временских серија

Davidson and MacKinnon (2021), глава 13. Задаци: 13.18, 13.21

II Начин полагања испита – писмено

Испит из области Анализе временских серије полаже се писмено израдом теста са питањима отвореног типа. Питања су доминантно теоријског типа. Тест чине три целине. Свака целина садржи три питања.