

EKONOMSKI FAKULTET UNIVERZITETA U BEOGRADU  
MASTER: KVANTITATIVNA EKONOMIJA/EKONOMETRIJA  
PREDMET: PRIMENJENA ANALIZA VREMENSKIH SERIJA  
PROFESOR: ZORICA MLAĐENOVIĆ  
Školska godina 14/15.

### Okvirni sadržaj predmeta

- Metodologija makroekonometrijskog modeliranja. Različiti pristupi u modeliranju: simultane jednačine, deduktivno modeliranje i VAR model.
- Kointegraciona analiza. Testiranje postojanja kointegracije u slučaju dve vremenske serije.
- VAR model: postavka, ocena parametara, uslov stacionarnosti, testovi specifikacije i testovi uzročnosti. Strukturni VAR model.
- VAR model: funkcija impulsnog odziva i dekompozicija varijanse greške predviđanja.
- Kointegraciona analiza i VAR modeli: vektorska forma sa korekcijom ravnotežne greške, reprezentacija zajedničkih trendova, odgovarajuća vektorska forma pokretnih proseka.
- Ocena kointegrisanog VAR modela: metod maksimalne verodostojnosti.
- Testiranje postojanja kointegracije (određivanje broja kointegracionih vektora): test-statistika količnika verodostojnosti (test-statistika traga), asimptotska raspodela u prisustvu različitih determinističkih komponenti, kombinacija različitih pristupa u određivanju broja kointegracionih vektora.
- Identifikacija kointegracionih relacija. Identifikacija slabe egzogenosti. Testiranje hipoteza o vrednostima kointegracionih parametara. Testiranje hipoteza o vrednostima parametara prilagodavanja.
- Ekonomski primeri

Ocena se formira na osnovu usmenog izlaganja (40% ocene) i pismenog ispita (60% ocene).

Literatura:

- Enders, W. (2004), *Applied Econometric Time Series*, Wiley, New York, 2<sup>nd</sup> ed.  
Juselius, K. (2006), *The Cointegrated VAR Model: Methodology and Applications*, Oxford University Press, Oxford.  
Mladenović, Z. i A. Nojković (2015), *Primenjena analiza vremenskih serija*, Ekonomski fakultet, Beograd, II izdanje.  
Mladenović, Z. (2002), Praktični problemi kointegracione analize, *Ekonomski anali* 155, 35-53.  
Mladenović, Z. (2012), Prezentacije sa predavanja, <http://avs.ekof.bg.ac.rs>.