

EKONOMSKI FAKULTET UNIVERZITETA U BEOGRADU  
**MASTER:** MEĐUNARODNA EKONOMIJA, EKONOMSKA ANALIZA I POLITIKA,  
MAKROEKONOMIJA PRIVREDA U TRANZICIJI  
**PREDMET:** EKONOMETRIJSKI METODI I MODELI  
**PREDAVAČ:** PROFESOR ZORICA MLADENović  
**ŠKOLSKA GODINA:** 2015/2016.

## **I CILJ PREDMETA**

Cilj predmeta je da upozna studente sa ekonometrijskim metodama i modelima koji se koriste u makroekonomiji i da ih osposobi za samostalna empirijska istraživanja. Na časovima predavanja izlažu se, kako teorijske osnove ekonometrijskih modela, tako i njihova uloga u ekonomskim analizama. Časovi vežbi namenjeni su sticanju praktičnih znanja. Ovi časovi se organizuju u računskom centru da bi studenti naučili da primenom programskog paketa EVIEWS modeliraju konkretne ekonomske podatke i na osnovu toga izvode ekonomske zaključke.

**Budući da predmet ima status izbornog, organizacija i sadržaj nastave zavise, kako od broja prijavljenih studenata, tako i od predznanja iz ekonometrije.**

## **II SADRŽAJ PREDMETA**

**Za studente koji u prethodnom školovanju nisu izučavali ekonometriju:**

### **Osnove ekonometrije**

1. Klasični regresioni model: pretpostavke i metode ocenjivanja.
2. Svojstva ocena i statističko zaključivanje u klasičnom regresionom modelu.
3. Neka odstupanja od osnovnih pretpostavki klasičnog regresionog modela (autokorelacija, heteroskedastičnost, multikolinearnost, odsustvo normalne raspodele).
4. Specifikacija i izbor modela.
5. Sistemi simultanih jednačina.

**Za studente koji su u prethodnom školovanju izučavali ekonometriju:**

### **Modeli i metodi vremenskih serija**

1. Osnovni pojmovi. Stacionarnost.
2. Jednodimenzioni modeli stacionarnih vremenskih serija.
3. Obična i parcijalna autokorelaciona funkcija.
4. Jedinični koren u vremenskim serijama. Testovi jediničnog korena.
5. Kointegracija. Model sa korekcijom ravnotežne greške.

### III OSNOVNA LITERATURA

Mladenović i Petrović (2014), *Uvod u ekonometriju*, VI izdanje, Ekonomski fakultet, Beograd

Mladenović i Nojković (2015), *Primenjena analiza vremenskih serija*, II izdanje, Ekonomski fakultet, Beograd

Mladenović i Nojković (2014), *Zbirka rešenih zadataka iz ekonometrije*, VII izdanje, Ekonomski fakultet, Beograd

Izvodi sa predavanja, <http://avs.ekof.bg.ac.rs>

### IV NAČIN POLAGANJA ISPITA

Finalni pismeni ispit