

КАТЕДРА ЗА УПРАВЉАЊЕ СИСТЕМИМА

Факултет организационих наука

Катедра за управљање системима

■ Наставници :

- др Ивана Драговић, ванредни професор
- др Ана Поледица, ванредни професор
- др Павле Милошевић, доцент
- др Александар Ракићевић, доцент

■ Сарадници:

- Милица Зукановић, сарадник у настави

■ Лабораторија за системе:

- Кабинет 211
- [http:// labsys.fon.rs](http://labsys.fon.rs)



Катедра за управљање системима

Катедра за операциона истраживања и статистику

Временске серије и фрактали

Временске серије и фрактали

- Циљеви предмета:

- Овладавање техникама анализе и моделовања временских серија
- Примена модела временских серија у предвиђањима тренда и волатилности у изабраном програмском језику
- Разумевање концепата теорије фрактала



Временске серије и фрактали

■ Тематске целине:

- Основне карактеристике временских серија.
- Моделовање тренда. Ауторегресиони (AR) модел. Модел покретног просека (MA). ARMA и ARIMA модели.
- Моделовање волатилности. Условно хетероскедастични (ARCH) модели. GARCH модел и његове модификације.
- Анализа вишедимензионалних временских серија и VAR модел.
- Нелинеарни модели NAR, NARX.
- Фрактали и мултифрактали.



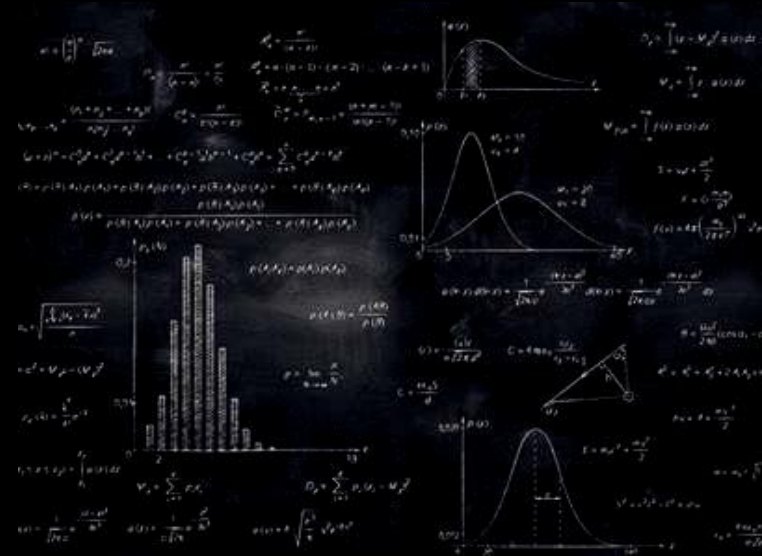
Временске серије и фрактали

■ Начин извођења наставе

- Теоријска настава
- Практична настава
- Менторски рад

■ Начин полагања испита

- Активност на настави (10%)
- Домаћи задаци (30%)
- Пројектни задатак (60%)



Ви питате,
ми одговарамо.

ivana.dragovic@fon.bg.ac.rs

ana.poledica@fon.bg.ac.rs

pavle.milosevic@fon.bg.ac.rs

aleksandar.rakicevic@fon.bg.ac.rs