

Испитна питања из Временских серија 2014/15.

1. Тестови случајности (Тест тачака заокрета)
2. Тестови нормалности
3. Методе трансформације временске серије
4. Изравнање серије методом покретних просека и клизећи полиномни тренд
5. Изравнање серије уз помоћ регресионих метода
6. Издвајање и елиминација сезонске компоненте временске серије
7. Линеарни процес
8. Парцијална аутокорељациона функција (дефиниција и израчунавање)
9. $AR(1)$ модел временске серије
10. $AR(2)$ модел временске серије
11. $AR(p)$ модел временске серије
12. $MA(1)$ модел временске серије
13. $MA(2)$ модел временске серије
14. $MA(q)$ модел временске серије
15. $ARMA(1, 1)$ модел временске серије
16. $ARMA(p, q)$ модел временске серије
17. Прогнозирање стационарних временских серија
18. Тестови јединичног корена (*Dickey – Fuller* тест)
19. Моделовање линеарног тренда
20. *ARIMA* модели и сезонски *ARIMA* модели
21. Моделовање структурног лома
22. Коинтеграција временских серија
23. Векторске временске серије и *VAR* модели
24. Услов стационарности $VAR(1)$ модела
25. Услов стационарности $VAR(k)$ модела
26. Узрочност временских серија