

Испитна питања из Временских серија 2025/26.

1. Изравнавање серије методом покретних просека
2. Експоненцијално изравнавање
3. Изравнавање серије уз помоћ регресионих метода
4. Издавање и елиминација сезонске компоненте временске серије
5. Линеарни процес
6. $AR(1)$ модел временске серије
7. $AR(p)$ модел временске серије
8. $MA(1)$ модел временске серије
9. $MA(q)$ модел временске серије
10. $ARMA(1, 1)$ модел временске серије
11. $ARMA(p, q)$ модел временске серије
12. Парцијална аутокорељациона функција (дефиниција и израчунавање)
13. Парцијална аутокорељациона функција AR модела
14. Парцијална аутокорељациона функција MA модела
15. Прогноза серије са минималном средње квадратном грешком (дефиниција и особине)
16. Прогнозирање линеарног процеса
17. Прогнозирање MA модела
18. Прогнозирање AR модела
19. Прогнозирање $ARMA$ модела
20. Оцењивање параметара серије методом момената
21. Оцењивање параметара серије методом најмањих квадрата
22. Оцењивање параметара серије методом нелинеарних најмањих квадрата
23. Оцењивање параметара серије методом максималне веродостојности
24. Детерминистички и стохастички тренд
25. Тестови јединичног корена (*Dickey – Fuller* тест)
26. $ARIMA$ модели
27. Сезонски $ARIMA$ модели
28. Моделовање структурног лома

- 29. *ARCH* и *GARCH* модели
- 30. Векторске временске серије и *VAR*, *VMA*, *VARMA* модели
- 31. Услов стационарности *VAR* модела
- 32. Узрочност временских серија
- 33. Коинтеграција временских серија