Студијски програм: Основне академске студије - Математика			
Назив предмета: Временске серије и примена у финансијама			
Наставник: Јелена М. Јоцковић			
Статус предмета: Обавезни за модул Статистика, актуарска и финансијска математика			
Број ЕСПБ: 6			
Услов: Случајни процеси			
Циљ предмета: Стицање општих и специфичних знања из области анализе временских серија			
Исход предмета: По завршетку курса, студент има основна знања о врстама временских серија и методама њиховог проучавања.			
Садржај предмета: Модели временских серија. Тестирање случајности. Неслучајне компоненте. ARMA модели. Оцењивање параметара. Прогнозирање временских серија. Парцијална корелација. ARIMA модели. Избор модела. Временске серије у финансијама.			
Литература: 1. J. Mališić, *Vremenske serije*, Matematički fakultet, Beograd, 2002 2. W.A. Fuller, *Introduction to Statistical Time Series,* John Wiley, New York, 1976 3. C. Chatfield, *TheAnalysis of Time Series – An Introduction*, Chapman and Hall, USA, 2004 4. J. Mališić, V. Jevremović, *Slučajni procesi i vremenske serije*, Matematički fakultet, Beograd, 2008			
Број часова активне наставе: 5	**Теоријска настава**: 3	**Практична настава**: 2	
Методе извођења наставе: Фронтални, групни и практични.			
Оцена знања (максимални број поена 100)			
Предиспитне обавезе	поена	**Завршни испит**	поена
активност у току предавања		писмени испит	
практична настава	20	усмени испит	40
колоквијум			
семинар	40		