

Ekonomski fakultet / EKONOMIJA / EKONOMETRIJA II

Naziv predmeta:	EKONOMETRIJA II			
Šifra predmeta	Status predmeta	Semestar	Broj ECTS kredita	Fond časova (P+V+L)
11712	Obavezan	1	8	4+2+0
Studijski programi za koje se organizuje	EKONOMIJA			
Uslovljenost drugim predmetima				
Ciljevi izučavanja predmeta	Studenti se upoznaju sa ekonometrijskim metodama i modelima koji se koriste u savremenoj ekonomiji sa ciljem da se osposobe za samostalna empirijska istraživanja.			
Ishodi učenja	Očekuje se da studenti nakon položenog ispita iz predmeta Ekonometrija II mogu: • objasniti i implementirati osnovne ekonometrijske tehnike u makroekonomskim analizama; • koristiti i obrazložiti odgovarajuće ekonometrijske testove stacionarnosti i kointegracije vremenskih serija i na odgovarajući način modelirati empirijske podatke vremenskih serija; • koristiti ekonometrijski program EViews za ocjenjivanje makroekonometrijskih modela; • samostalno sprovesti ekonometrijsku analizu zasnovanu na empirijskim podacima i interpretirati njene rezultate; pratiti i razumjeti stručnu i naučnu literaturu u kojoj su rezultati izraženi ekonometrijskim terminima.			
Ime i prezime nastavnika i saradnika	Prof. dr Vesna K. Karadzic, Mr Bojan Pejović			
Metod nastave i savladanja gradiva	Na časovima predavanja ce biti izložene teorijske osnove ekonometrijskih modela i njihova uloga u ekonomskim analizama. Časovi vježbi namijenjeni su sticanju praktičnih znanja, tako da omoguće studentima da primjenom programskog paketa EViews modeliraju konkretne ekonomske podatke i izvode određene ekonomske zaključke.			
Plan i program rada				
Pripremne nedjelje	Priprema i upis semestra			
I nedjelja, pred.	Uvodna razmatranja. Osnovni statistički koncepti i matični račun.			
I nedjelja, vježbe	Uvodna razmatranja. Osnovni statistički koncepti i matični račun.			
II nedjelja, pred.	Ekonomski podaci i ekonometrijski modeli.			
II nedjelja, vježbe	Ekonomski podaci i ekonometrijski modeli.			
III nedjelja, pred.	Statističko zaključivanje.			
III nedjelja, vježbe	Statističko zaključivanje.			
IV nedjelja, pred.	Dinamički modeli.			
IV nedjelja, vježbe	Dinamički modeli.			
V nedjelja, pred.	Stacionarnost. Testiranje stacionarnosti.			
V nedjelja, vježbe	Stacionarnost. Testiranje stacionarnosti.			
VI nedjelja, pred.	Modeli vremenskih serija. Izbor modela. Predviđanje.			
VI nedjelja, vježbe	Modeli vremenskih serija. Izbor modela. Predviđanje.			
VII nedjelja, pred.	Lažna regresija vs. Kointegracija.			
VII nedjelja, vježbe	Lažna regresija vs. Kointegracija.			
VIII nedjelja, pred.	Multivarijantni modeli i kointegracija.			
VIII nedjelja, vježbe	Multivarijantni modeli i kointegracija.			
IX nedjelja, pred.	Modeliranje drugih momenata: ARCH i GARCH modeli			
IX nedjelja, vježbe	Modeliranje drugih momenata: ARCH i GARCH modeli.			
X nedjelja, pred.	Analiza panel podataka: osnovni koncepti.			
X nedjelja, vježbe	Analiza panel podataka: osnovni koncepti.			
XI nedjelja, pred.	Metode za analizu panel podataka: fiksni efekat.			
XI nedjelja, vježbe	Metode za analizu panel podataka: fiksni efekat.			
XII nedjelja, pred.	Metode za analizu panel podataka: slučajni efekat.			
XII nedjelja, vježbe	Metode za analizu panel podataka: slučajni efekat.			

XIII nedjelja, pred.	Izbor modela. Osnovne strategije u izgradnji modela.					
XIII nedjelja, vježbe	Izbor modela. Osnovne strategije u izgradnji modela.					
XIV nedjelja, pred.	Dijagnostički testovi.					
XIV nedjelja, vježbe	Dijagnostički testovi.					
XV nedjelja, pred.	Rekurzivna regresija.					
XV nedjelja, vježbe	Rekurzivna regresija.					
Opterećenje studenta						
Nedjeljno			U toku semestra			
8 kredita x 40/30=10 sati i 40 minuta 4 sat(a) teorijskog predavanja 0 sat(a) praktičnog predavanja 2 vježbi 4 sat(a) i 40 minuta samostalnog rada, uključujući i konsultacije			Nastava i završni ispit: 10 sati i 40 minuta x 16 =170 sati i 40 minuta Neophodna priprema prije početka semestra (administracija, upis, ovjera): 10 sati i 40 minuta x 2 =21 sati i 20 minuta Ukupno opterećenje za predmet: 8 x 30=240 sati Dopunski rad za pripremu ispita u popravnom ispitnom roku, uključujući i polaganje popravnog ispita od 0 do 30 sati (preostalo vrijeme od prve dvije stavke do ukupnog opterećenja za predmet) 48 sati i 0 minuta Struktura opterećenja: 170 sati i 40 minuta (nastava), 21 sati i 20 minuta (priprema), 48 sati i 0 minuta (dopunski rad)			
Obaveze studenta u toku nastave			Učešće na časovima predavanja i vježbi, seminarski rad.			
Konsultacije			Poslije predavanja.			
Literatura			1. Kenneth G. Stewart, Introduction to Applied Econometrics, Brooks/Cole Thomson Learning, Belmont, 2005. 2. Asteriou and Hall, Applied Econometrics, Palgrave, 2007 3. James D. Hamilton, Time Series Analysis, Princeton University Press, 1994. 4. William H. Green, Econometric Analysis (7th Edition), Prentice Hall, New Jersey, 2012.			
Oblici provjere znanja i ocjenjivanje			Kolokvijum, završni ispit			
Posebne naznake za predmet						
Napomena						
Ocjena:	F	E	D	C	B	A
Broj poena	manje od 50 poena	više ili jednako 50 poena i manje od 60 poena	više ili jednako 60 poena i manje od 70 poena	više ili jednako 70 poena i manje od 80 poena	više ili jednako 80 poena i manje od 90 poena	više ili jednako 90 poena