

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:

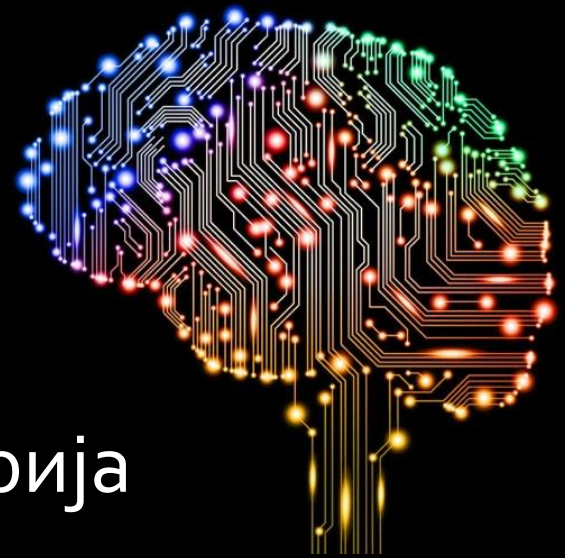
- Милица Зукановић, сарадник у настави

■ Лабораторија за системе:

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

Чиме се бавимо

- Управљање системима
- Рачунарска интелигенција
- Машинско учење
- Финансијски инжењеринг
- Моделовање временских серија
- Алгоритамско трговање



Предмети

Обавезни предмет

- Рачунарска интелигенција у финансијама

Изборни предмети

- Алгоритамско трговање и високофреквентне финансије
- Моделовање и управљање системима
- Временске серије и фрактали



Катедра за управљање системима

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.



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