

КАТЕДРА ЗА УПРАВЉАЊЕ СИСТЕМИМА

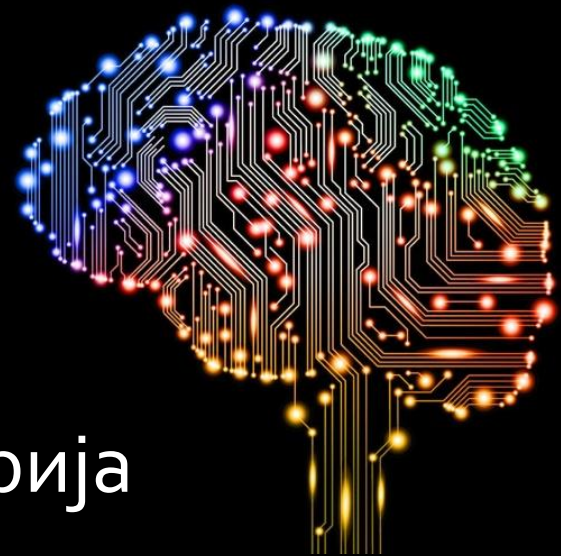
Факултет организационих наука

Катедра за управљање системима

- **Наставници :**
 - др Ана Поледица, ванредни професор
 - др Ивана Драговић, ванредни професор
 - др Павле Милошевић, ванредни професор
 - др Александар Ракићевић, доцент
- **Сарадници:**
 - Милица Зукановић, асистент
 - Матеа Лукић, сарадник ван радног односа
- **Лабораторија за системе:**
 - Кабинет 211
 - <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.



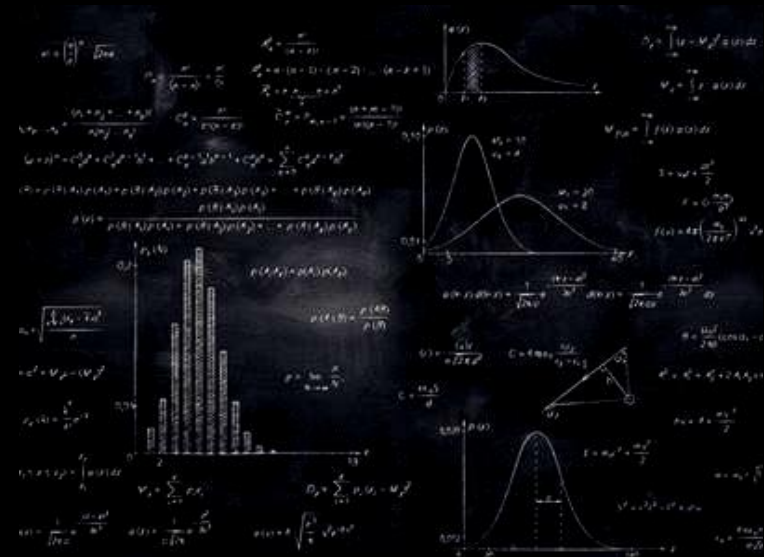
Временске серије и фрактали

■ Начин извођења наставе

- Теоријска настава
- Практична настава
- Менторски рад

■ Начин полагања испита

- Активност на настави (10%)
- Пројектни задаци (50%)
- Усмени испит – одбрана пројекта (40%)



Ви питате,
ми одговарамо.

ana.poledica@fon.bg.ac.rs

aleksandar.rakicevic@fon.bg.ac.rs