

Табела 5.1 Спецификација предмета на студијском програму докторских студија

Назив предмета: Методи и технике квантитативних истраживања		
Наставник или наставници: Савић др Мирко, Брцанов др Дејан, Радованов др Борис, Дакић др Стојанка		
Статус предмета: изборни		
Број ЕСПБ: 10		
Услов: нема		
Циљ предмета Упознавање студената са различитим методима напредне економетријске анализе, појмовима и методима савремене мултиваријационе и економетријске анализе, као и њихова практична примена; Пружају се знања у области оцењивања, тестирања и интерпретације економетријских модела различитих типова уз примену одговарајућег економетријског софтвера (Eviews и Gretl).		
Исход предмета Студент је способен да уочи економски проблем, да формира адекватан узорак и да за одговарајући проблем изабере и имплементира адекватан економетријски модел уз употребу економетријског софтвера. Студент уме да постави хипотезе истраживања на основу мултиваријационих података, зна да испита претпоставке за примену мултиваријационих техника, уме да изабере адекватну статистику теста приликом примене мултиваријационе анализе варијансе, зна да испита повезаност варијабли и изведених варијанта.		
Садржај предмета <i>Теоријска настава -</i> Репетиторијум основних појмова из економетрије, панел модели, биномна логистичка регресија, мултиноминална логистичка регресија, логистичка регресија са ранговима, модели са пребројавањем података. Мултиваријациона нормална расподела, Хотелинг T2 расподела, MANOVA - напредне теме мултиваријационе анализа варијансе, Каноничка корелација. Увод у берзанско пословање, Мерење перформанси инвестиционих портфолија, Моделирање финансијског ризика, Напредна анализа временских серија. <i>Практична настава -</i> Задачи и проблеми који се решавају на практичној настави прате садржај предавања, тј. теоријске наставе. Коришћење економетријског софтвера (Eviews и Gretl). Рад на бази студија случаја кроз примену насталих финансијских података и одговарајућих софтверских решења		
Препоручена литература 1. Stock, J. & Watson, M. (2015). Introduction to Econometrics, 3rd edition. Pearson Education, Inc. 2. Rencher, C. A. (2002). Methods of Multivariate Analysis, (2nd ed.). Wiley - Interscience, New York 3. Tabachnick, G., Fidell, L. (2013). Using Multivariate Statistics (6th ed.). Pearson Education, Inc: Boston 4. Benninga, S. (2014). Financial Modeling – Fourth Edition. Massachusetts Institute of Technology. 5. Rees, M. (2018). Principles of Financial Modelling: Model Design and Best Practices Using Excel and VBA. John Wiley & Sons.		
Број часова активне наставе	Теоријска настава: 5	Практична настава: 5
Методе извођења наставе: Усмено предавање, презентације у електронској форми, израда задатака, практичан рад у рачунарској лабораторији у одабраним алатима у оквиру вежби, студије случаја.		
Оцена знања (максимални број поена 100)		
Активност:	Мин. Бодова	Макс. бодова
Активности у истраживању	5	10
Пристапни радови	30	60
Усмени испит	16	30
СВЕГА	51	100