

M662, Регресиона анализа у финансијама

План и програм наставе

1. Прости и вишеструки линеарни регресиони модели.
2. Оцењивање параметара методом најмањих квадрата.
3. Тестирање хипотеза и интервали поверења коефицијената регресионог модела.
4. Геометрија најмањих квадрата. Центрирана форма.
5. Теорија нормалне регресије за једнодимензиони случај.
6. Оцене регресионог модела методом максималне веродостојности.
7. Тест количника веродостојности.
8. Најбоља прогноза једнодимензионог обележја на основу вектора предиктора.
9. Коефицијент детерминисаности нормалних модела.
10. Тестирање коефицијента детерминисаности. Дијагностика модела.
11. Избор променљивих и постепена регресија.
12. Мултиваријациона вишеструка линеарна регресија. Основни појмови, предвиђање и прогнозирање.
13. Регресиони модели са случајним предикторима. Нормални модел са стандардизованим регресионим коефицијентима.
14. Основе нелинеарних регресионих модела. Логистичка регресија.
15. Логлинеарни регресиони модел. Пуасонов регресиони модел.