

**SEMINARUL DE MODELARE MACROECONOMICA
RAPORT DE ACTIVITATE 2009**

**Coordonarea Seminarului de Modelare Macroeconomica:
acad. Emilian DOBRESU**

Curs pe teme de econometrie aplicată, comunicări și dezbateri

Partea I Sesiunea de vară

Tema	Data	
1. Capitol introductiv. Demonstrații privind utilizarea soft-ului Eviews.	10 febr. 2009	Prof. Dorin Jula
2. -Regresia standard. Specificare. Estimare. Lucrul cu ecuații în Eviews. Comunicare științifică: Criterii informaționale și heteroscedasticitatea erorilor.	17 febr 2009	Prof. Dorin Jula Prof. Ciuiu Daniel
3. –Alte metode de rezolvare a ecuațiilor. Metoda în două stagii. Comunicare științifică: Modele macroeconomice ale inflației	24 febr 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Andrei Dospinescu
4. - Prognoza econometrică. -Curs EVIEWS Metode adiționale de regresie. Regresia ponderată. Regresia în două etape. Regresia nelineară.	3 martie 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Pauna Bianca
5. - Modele econometrice cu ecuații simultane. - Curs EVIEWS: Serii de timp: Regresia cu serii de timp – Teoria Corelației Seriale; Testarea prezenței Corelației Seriale.	10 martie 2009	Prof. Dorin Jula Dr. Caraiani Petre
6. - Noțiuni generale privind econometria seriilor de timp. - Curs EVIEWS: Serii de timp II: Estimarea Modelelor AR; Teoria ARIMA; Estimarea Modelelor ARIMA; Teste diagnostic pentru regresii ARMA.	17 martie 2009	Prof. Dorin Jula Dr. Caraiani Petre
7. - Staționaritatea seriilor de timp. Teste de rădăcină unitate. - Curs EVIEWS: Serii de timp III – Regresia cu serii de timp – Serii de timp nestaționare; Teste de rădăcină unitate; Teste panel de rădăcină unitate.	24 martie	Prof. Dorin Jula Dr. Caraiani Petre
8. - Staționaritatea seriilor de timp. Teste de rădăcină unitate (II). - Curs EVIEWS: Serii de timp IV – Regresia cu serii de timp – Serii de timp nestaționare; Teste de rădăcină unitate; Teste panel de rădăcină unitate. - Rețele de calculatoare	31 martie 2009	Prof. Dorin Jula Dr. Caraiani Petre Dr. Mateescu Daniel
9. – Cointegrarea - Curs EVIEWS: Prognoză pe baza unei singure	7 aprilie 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Dospinescu Andrei

ecuații. - Rețele de calculatoare		Dr. Mateescu Dan
10. - Cointegrarea (cont.) - Curs EVIEWS: Teste diagnostic și de specificare. Teste la nivel de coeficienți. - Rețele de calculatoare	28 aprilie 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Dopsinescu Andrei Prof. Mateescu Daniel
10. - Modele corectoare de erori - Curs EVIEWS: Teste ale reziduurilor. Teste de stabilitate. - Surse de documentare pe internet	5 mai 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Dopsinescu Andrei Prof. Mateescu Daniel
11. - Modele ARIMA. Metodologia Box-Jenkins - Curs EVIEWS: Măsurarea volatilității în seriile de timp - Modele ARCH și GARCH	12 mai 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Saman Corina
12. - Modele ARIMA. Metodologia Box-Jenkins (cont.) - Curs EVIEWS: Măsurarea volatilității în seriile de timp - Modele ARCH și GARCH (cont.) Comunicare științifică: Mecanismele de transmisie a politicii monetare prin canalul cursului de schimb. Cazul României	19 mai 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Saman Corina Dr. Pelinescu Elena
13. - Modele ARIMA. Metodologia Box-Jenkins (cont.) - Curs EVIEWS: Modele de tip discret și cu variabile dependente	26 mai 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Saman Corina
14. - Modele VAR - curs EVIEWS: Metoda verosimilității maxime	2 iunie 2009	Prof. Dorin Jula Dr Pelinescu Elena
15. - Modele VAR (cont.) Presușinerea tezei de doctorat: “Analiza dinamicii și determinanții consumului în România”	9 iunie 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Pauna Bianca
16. - Econometria variabilelor calitative Presușinerea tezei de doctorat: „Piața muncii în tranziție – elemente de continuitate și schimbări structurale” Comunicare științifică: Colinearitatea	16 iunie 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Pauna Catalin Dr. Pavelescu Florin
17. - Econometria datelor de tip panel - Curs EVIEWS: Estimarea sistemelor – perspectivă generală; Metode de estimare a sistemelor; Cum este construit și specificat un sistem.	23 iunie 2009	Prof. Dorin Jula Drd. Dopsinescu Andrei
18. - Econometria datelor de tip panel (cont.) - Curs EVIEWS: Vectori autoregresivi și modele de corecție a erorii	30 iunie 2009	Prof. Dorin Jula Dr. Pelinescu Elena

Partea II Sesiunea de toamnă

Nr.	Tema	Data	
1	<p>- Prognoza econometrică - Teorema lui Bayes, Densitate de probabilitate a-priori, Repartitie marginala conditionata (a-posteriori) pentru parametri. Estimatori punctuali. Estimari prin intervale de incredere bayesiene.</p> <p>Comunicare stiintifica: “Locul bayesianismului in epistemologia inferentei si probabilitatii”</p>	6 oct 2009	<p>Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie</p> <p>Acad. Emilian Dobrescu</p>
2	<p>Comunicare stiintifica: “Elinor Ostrom si Oliver E. Williamson – laureati ai Premiului Nobel pentru economie pe anul 2009”.</p> <p>- Modele econometrice cu ecuații simultane - Distributii folosite in predictii, distributia marginala a observatiilor, estimatori punctuali si intervale de incredere corespunzatoare. Proprietati asimptotice ale distributiilor bayesiene a-posteriori.</p> <p>Presustinerea tezei: „Analiza riscului în evaluarea oportunităților internaționale de investiții. Perspective în modelarea și previzionarea volatilității utilizate în estimarea riscului”</p>	13 oct. 2009	<p>Acad. Emilian Dobrescu</p> <p>Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie</p> <p>Drd. Marius Matei</p>
3	<p>- Noțiuni generale privind econometria seriilor de timp - Aplicatii la principul de optimalitate Pareto si la distributia binomiala. Modelul regresiei liniare. Probleme speciale in modelul de regresie.</p>	20 oct. 2009	<p>Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie</p>
4	<p>Comunicare stiintifica: “Costin Murgescu – promotor al deschiderilor economice moderne (la implinirea a 90 de ani de la nastere)”.</p> <p>- Staționaritatea seriilor de timp. Teste de rădăcină unitate - Formele functionale si structurale ale problemei erorilor in variabile. Analiza modelelor neliniare ce constau intr-o singura ecuatie.</p>	27 oct. 2009	<p>Acad. Emilian Dobrescu</p> <p>Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie</p>
5	- Staționaritatea seriilor de timp.	3 nov.	Prof. Univ. Dorin Jula

	Teste de rădăcină unitate (cont.) - Serii de timp: Modelul AR(1), modelul AR(1) cu date incomplete, analiza modelelor cu lag. Modele de regresie multivariate.	2009	Dr. Adriana Agapie
6	- Cointegrarea - Modele econometrice cu ecuatii simultane. Compararea si testarea ipotezelor. Probleme de control optimal.	10 nov. 2009	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
7	- Modele corectoare de erori - Algoritmi de generare din distributii de probabilitate clasice. Generare stratificata .	17 nov. 2009	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
8	- Modele ARIMA. Metodologia Box-Jenkins - Monte Carlo conditionat. Simularea distributiilor de probabilitate a-posteriori.	24 nov. 2009	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
9	Comunicare stiintifica: Cercetarea economica asistata de har - Modele ARIMA. Metodologia Box-Jenkins (cont.) - Testarea empirica a ipotezelor statistice.	8 dec. 2009	Prof. Costea Munteanu Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
10	- Modele ARIMA. Metodologia Box-Jenkins (cont.) - prezentarea articolelor: Geweke, J. 1989 ‘Bayesian Inference in Econometric Models using Monte Carlo Integration”, Econometrica 57, 1317-1339	15 dec. 2009	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie