

PROGRAM
SEMINARUL DE MODELARE MACROECONOMICA
Coordonator: acad. Emilian DOBRESU

Perioada: februarie 2010- iunie 2010

Programul seminarului cuprinde:

- continuarea cursului de Econometrie si Prognoza tinut de domnul profesor univ. dr. Dorin Jula;
- continuarea cursului de statistică Bayesiană tinut de dr. Agapie Adriana;
- continuarea cursului de Econometrie aplicată. Utilizarea pachetului de programe Eviews (vineri);
- comunicări științifice.

Nr.	Tema	Data	
1	- Metode de prognoză pe termen scurt. Netezirea exponențială simplă, dublă (Brown, Holt) și triplă (Brown). - Distribuții folosite în predicții.	09.02.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
2	- Metode de prognoză pe termen scurt. Utilizarea metodelor de netezire exponențială în analiza bursieră tehnică - banda Bollinger, MACD. - Distribuții folosite în predicții (cont.)	16.02. 2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
3	- Metode de prognoză pe termen scurt. Modelul Holt-Winters Distribuții folosite în predicții (cont.)	23.02.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
V1	Metode de estimare a sistemelor	26.02.2010	Drd. Andrei Dospinescu
4	-Metode de desezonalizare - Aplicații la principiul de optimalitate Pareto și la distribuția binomială. Modelul regresiei liniare.	02.03.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
5	- Procese aleatoare non-staționare. Staționaritatea. Procese de tip TS și DS - Aplicații la principiul de optimalitate Pareto și la distribuția binomială. Probleme speciale în modelul de regresie. - Problemele capitalismului modern	09.03. 2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie Prof. Univ. Daniel Daianu
V2	Modele în spațiul stărilor și filtrul Kalman	12.03.2010	Drd. Andrei Dospinescu

6	- Procese aleatoare non-staționare. Staționaritatea. Teste de rădăcina unitate. - Formele functionale si structurale ale problemei erorilor in variabile. - Economie si Religie	16.03.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie Prof. Univ. Costea Munteanu
7	- Modele de tip ARIMA (metodologia Box-Jenkins) Modele autoregresive AR(p) - Analiza modelelor neliniare ce constau intr-o singura ecuatie.	23.03. 2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
V3	Construirea modelelor în EViews	26.03.2010	Drd. Bianca Pauna
8	- Modele ARIMA (metodologia Box-Jenkins) Modele de medie mobilă MA(q) - Serii de timp: Modelul AR(1), modelul AR(1) cu date incomplete.	30.03.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
V4	Estimarea modelelor și interpretarea rezultatelor	09.04.2010	Drd. Bianca Pauna
9	Serii de timp: analiza modelelor cu lag. Modele de regresie multivariate.	13.04.2010	Dr. Adriana Agapie
10	- Modele ARIMA. Modele ARMA(p,q), ARIMA(p,d,q) - Modele econometrice cu ecuatii simultane. Compararea si testarea ipotezelor.	20.04.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
V5	Analiza factorială (1)	23.04.2010	Dr. Petre Caraiani
11	- Identificarea modelelor de tip ARIMA(p,d,q). - Modele econometrice cu ecuatii simultane. Probleme de control optimal.	27.04.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
12	- Prognoza în cazul modelelor de tip ARIMA(p,d,q) - Algoritmi de generare din distributii de probabilitate clasice.	04.05.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
V6	Analiza factorială (2)	07.05.2010	Dr. Petre Caraiani
13	- Modele de tip ARCH - Algoritmi de generare: generare stratificata	11.05.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
14	-Cointegrarea și modele corectoare de erori. Cointegrarea - Monte Carlo conditionat	18.05.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie
V7	Programarea în EViews (1)	21.05.2010	Drd. Corina Saman
15	- Cointegrarea și modele corectoare de erori. Modele ECM - Simularea distributiilor de probabilitate a-posteriori.	25.05.2010	Prof. Univ. Dorin Julia Dr. Adriana Agapie

16	- Modele de tip VAR. Reprezentarea unui model VAR - Testarea empirica a ipotezelor statistice	01.06.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
17	- Modele de tip VAR. Estimarea parametrilor în modelele VAR - Prezentarea articolului: Geweke, J. 1989 ‘Bayesian Inference in Econometric Models using Monte Carlo Integration’, Econometrica 57, 1317-1339	08.06.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
V8	Programarea în EViews (2)	11.06.2010	Drd. Corina Saman
18	- Modele de tip VAR. Dinamica modelelor VAR (analiză a ocurențelor, descompunerea dispersiei) - Prezentarea articolului: Maddala, G.S., 1976, “Weak priors and sharp posteriors in simultaneous equation models”, Econometrica, 44, 345-351	15.06.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
19	- Econometria variabilelor de tip panel - Prezentarea articolului: Phillips, P.C. B., 1991, “To Criticize the Critics: An Objective Bayesian Analysis of Stochastic Trends”, Journal of Applied Econometrics, 6, 333-364	22.06.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie
V9	Programarea în EViews (3)	25.06.2010	Drd. Corina Saman
20	- Econometria variabilelor calitative - Prezentarea articolului: Schotman, P. and H.K. van Dijk, 1991, “A Bayesian Analysis of the unit root hypothesis”, Journal of Econometrics, 49, 195-238	29.06.2010	Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie