

RAPORT DE ACTIVITATE 2010

Coordonarea Seminarului INCE "Modelarea Macroeconomica": acad. Emilian DOBRESCU

Curs pe teme de econometrie aplicată,

comunicări și dezbateri

în anul 2010

Partea I Sesiunea de vară

| Nr. | Tema | Data | |
|-----|--|-------------|---|
| 1 | - Metode de prognoză pe termen scurt. Netezirea exponențială simplă, dublă (Brown, Holt) și triplă (Brown). - Aplicații la principiul de optimalitate Pareto și la distribuția binomială. Modelul regresiei liniare. 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. Aplicații la principiul de optimalitate Pareto și la distribuția binomială. Modelul regresiei liniare | 16.02. 2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 3 | - Metode de prognoză pe termen scurt. Modelul Holt-Winters Aplicații la principiul de optimalitate Pareto și la distribuția binomială. Modelul regresiei liniare | 23.02.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 4 | Metode de estimare a sistemelor | 26.02.2010 | Drd. Andrei Dospinescu |
| 5 | - Revising the growth model in Central and Eastern Europe. -Metode de desezonalizare | 02.03.2010 | Prof. Univ. Daniel Dăianu Prof. Univ. Dorin Jula |

| | | | |
|----|---|-------------|---|
| | - Aplicații la principiul de optimalitate Pareto și la distribuția binomială. Probleme speciale în modelul de regresie. | | Dr. Adriana Agapie |
| 6 | - 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 |
| 7 | Modele în spațiul stărilor și filtrul Kalman | 12.03.2010 | Drd. Andrei Dospinescu |
| 8 | - Procese aleatoare non-staționare. Staționaritatea. Teste de rădăcina unitate. - Formele funcționale și structurale ale problemei erorilor în variabile. - Economie și Religie | 16.03.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie Prof. Univ. Costea Munteanu |
| 9 | - Modele de tip ARIMA (metodologia Box-Jenkins) Modele autoregresive AR(p) - Analiza modelelor neliniare ce constau într-o singură ecuație. - Testele Bayes | 23.03. 2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie Dr. Daniel Ciuiu |
| 10 | Construirea modelelor în EViews | 26.03.2010 | Dr. Bianca Pauna |
| 11 | - Particularități ale repartițiilor cotelor de piață ale companiilor active pe piețele clasificate, din perspectiva gradelor de concentrare -Serii de timp: analiza modelelor cu lag. Modele de regresie multivariate. | 13.04.2010 | Prof. Cezar Mereuță Dr. Adriana Agapie |
| 12 | Estimarea modelelor și interpretarea rezultatelor | 16.04.2010 | Dr. Bianca Pauna |
| 13 | - Analiza tehnică pe piața de capital - Modele econometrice cu ecuații simultane. Compararea | 20.04.2010 | Drd. Marius Jula Dr. Adriana Agapie |

| | | | |
|----|---|------------|---|
| | si testarea ipotezelor. - presușinere tezei " <i>Produsul Intern Brut Potential; Modelare si Prognoza</i> " | | Drd. Marian Neagu |
| 14 | Analiza factorială (1) | 23.04.2010 | Dr. Petre Caraiani |
| 15 | - Identificarea modelelor de tip ARIMA(p,d,q). - Modele econometrice cu ecuatii simultane. Probleme de control optimal. | 27.04.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 17 | - Prognoza în cazul modelelor de tip ARIMA(p,d,q) - Algoritmi de generare din distributii de probabilitate clasice. | 04.05.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 18 | Analiza factorială (2) | 07.05.2010 | Dr. Petre Caraiani |
| 19 | - Modele de tip ARCH - Algoritmi de generare: generare stratificata | 11.05.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 20 | - Distribuția regională a presiunilor inflaționiste -Cointegrarea și modele corectoare de erori. Cointegrarea - Monte Carlo conditionat | 18.05.2010 | Prof. Dorel Ailenei Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 21 | Programarea în EViews (1) | 21.05.2010 | Drd. Corina Saman |
| 22 | - Cointegrarea și modele corectoare de erori. Modele ECM - Simularea distribuțiilor de probabilitate a-posteriori. - Multialternative Decision Making | 25.05.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie Dr. Daniel Ciuiu |
| 23 | - Modele de tip VAR. Reprezentarea unui model VAR - Testarea empirica a ipotezelor statistice | 01.06.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 24 | - Modele de tip VAR. Estimarea parametrilor în modelele VAR - Prezentarea articolului: Geweke, J. 1989 'Bayesian Inference in Econometric | 08.06.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |

| | | | |
|----|--|------------|---|
| | Models using Monte Carlo Integration", <i>Econometrica</i> 57, 1317-1339 | | |
| 25 | Programarea în EViews (2) | 11.06.2010 | Drd. Corina Saman |
| 26 | - Modele de tip VAR. Dinamica modelelor VAR (analiză □ocurilor, descompunerea dispersiei) - Prezentarea articolului: Maddala, G.S., 1976, "Weak priors and sharp posteriors in simultaneous equation models", <i>Econometrica</i> , 44, 345-351 - Acuratețea indicatorului Gini în măsurarea nivelului de sărăcie dintr-o populație | 15.06.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie Prof. Univ. Stefan Ștefănescu |
| 27 | - Solving some types of multiple attribute decision making problems - Econometria variabilelor de tip panel - Prezentarea articolului: Phillips, P.C. B., 1991, "To Criticize the Critics: An Objective Bayesian Analysis of Stochastic Trends", <i>Journal of Applied Econometrics</i> , 6, 333-364 | 22.06.2010 | Prof. Ion Văduva Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie |
| 28 | Programarea în EViews (3) | 25.06.2010 | Drd. Corina Saman |
| 29 | - Econometria variabilelor calitative - Prezentarea articolului: Schotman, P. and H.K. van Dijk, 1991, "A Bayesian Analysis of the unit root hypothesis", <i>Journal of Econometrics</i> , 49, 195-238 -presustinere teză "Metode de determinare a inflației de bază" | 29.06.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Adriana Agapie Drd. Andrei Dospinescu |

Partea II Sesiunea de toamnă

| Nr. | Tema | Data | |
|-----|---|------------|------------------------|
| 1 | - Metodologia Box-Jenkins: prezentate generală, | 05.10.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula |

| | | | |
|----|---|-------------|---|
| | coeficienții de autocorelare, coeficienții de autocorelare parțială, modele autoregresive AR(p) - susținere teză „Metode de determinare a inflației de bază” | | Drd. Andrei Dospinescu |
| 2 | - Contribuțiile științifice ale lui Peter Diamond, Dale Mortensen și Christopher Pissarides - laureati ai Premiului Nobel in Economie pentru anul 2010 - Metodologia Box-Jenkins: modele de medie mobilă MA(q), modele ARMA(p,q), modele ARIMA(p,d,q) - “Produsul Intern Brut Potential; Modelare și Prognoza” | 12.10. 2010 | Acad. Emilian Dobrescu Prof. Univ. Dorin Jula Drd. Marian Neagu |
| 3 | - Regresia ortogonală – ipoteze, definiție, estimare | 19.10.2010 | Drd. Corina Saman |
| 4 | - Metodologia Box-Jenkins: identificarea procesului, estimarea parametrilor, prognoza proceselor de tip Box-Jenkins | 26.10.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula |
| 5 | - Regresia ortogonală – testarea ipotezelor | 02.11. 2010 | Drd. Corina Saman |
| 6 | - Modele VAR: reprezentarea modelelor | 09.11.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula |
| 7 | - Modele VAR: estimarea parametrilor, analiza șocurilor, descompunerea varianței - Prezentarea soft-ului de calcul al indicatorului inflației de bază | 16.11. 2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Dr. Andrei Dospinescu |
| 8 | - Cointegrarea și modelele de corectare a erorilor | 23.11.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula |
| 9 | - Modele ARCH - Aplicarea metodei ACI în analizele pe piața muncii | 30.11.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula Cristina Lincaru |
| 10 | - Programul EViews: aplicații – | 07.12.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula |

| | | | |
|----|---|------------|------------------------|
| | <p>modelarea econometrică a seriilor de date de tip panel (prezentare generală, efecte fixe, efecte aleatorii, coeficienții aleatorii, teste de specificare a modelului – testul Chow, testul Hausman)</p> <p>- Referate și comunicări științifice</p> | | |
| 11 | <p>1. Programul EViews: aplicații – modelarea econometrică a seriilor de date de tip panel (prezentare generală, efecte fixe, efecte aleatorii, coeficienții aleatorii, teste de specificare a modelului – testul Chow, testul Hausman)</p> <p>- Referate și comunicări științifice</p> | 14.12.2010 | Prof. Univ. Dorin Jula |