

سازمان برنامه و بودجه کشور
مرکز پژوهش‌های توسعه و آینده‌نگری
کارگاه آموزشی:

"کاربردهای مدل‌های متقارن و غیرمتقارن با فراوانی مختلط (MIDAS)"

مشخصات مدرس:

- دکتر عباس ولدخانی
- استاد دانشگاه صنعتی سوين برن (SWINBURNE) استرالیا و پژوهشگر دانشگاه نیوانگلند و دانشگاه ملی استرالیا (ANU)
- حوزه‌های اصلی پژوهشی: مدل‌سازی اقتصاد کلان، اقتصادسنجی سری زمانی کاربردی، رفتار قیمت‌گذاری نامتقارن مؤسسات مالی بانکی و غیربانکی در بازارهای مالی، اقتصاد انرژی

سرفصل‌های دوره:

۱. اهمیت اطلاعات به موقع برای سیاست‌گذاری
 ۲. چارچوب تئوریک مدل‌های با فراوانی مختلط (MIDAS)
 ۳. چگونگی برخورد با تعداد زیاد پارامترهای با فراوانی بالا
 - توزیع با وقفه بتا
 - توزیع با وقفه چندجمله‌ای PDL
 - بررسی نحوه کاهش پارامترها با حفظ شکل‌گیری کلی توزیع وقفه‌ها در طول زمان
 ۴. مدل‌سازی MIDAS و AMIDAS در ایویوز 10 (Eviews 10)
 - نحوه ایجاد و اضافه کردن اطلاعات با فراوانی بالا
 - نحوه تغییر فراوانی اطلاعات از بالا به پایین و از پایین به بالا
 - نحوه انتخاب وقفه بهینه و توزیع مناسب
 - تفسیر نتایج در قالب دو مثال عملی
 - نحوه انجام پیش‌بینی خارج از دوره تخمین
- ملاحظات:** - جزوات و پاورپوینت‌ها قبل از شروع دوره در اختیار شرکت‌کنندگان قرار خواهد گرفت.
- شرکت‌کنندگان، امکان برقراری ارتباط آتی با مدرس از طریق پرسش و پاسخ و ویدئو کنفرانس خواهند داشت.

زمان برگزاری: یکشنبه، ۱۳۹۷/۳/۶، ساعت ۹:۳۰ لغایت ۱۲:۳۰