

รายงานสรุปผลการเข้าร่วมฝึกอบรม/สัมมนา หรือ ศึกษาต่อ ณ ต่างประเทศ

ชื่อ.....นางสาวศิวพร พรหมวงษ์.....ตำแหน่ง.....เศรษฐกรชำนาญการ.....

กอง.....นโยบายเศรษฐกิจมหภาค.....

ชื่อหลักสูตร/สาขา.....Macroeconometric Forecasting and Analysis.....

แหล่งทุน.....กองทุนการเงินระหว่างประเทศ. ประจำสาธารณรัฐสิงคโปร์.....

สถานที่.....สถาบันฝึกอบรมกองทุนการเงินระหว่างประเทศ. สาธารณรัฐสิงคโปร์.....

ระยะเวลา.....ระหว่างวันที่ ๒๓ มิถุนายน - ๔ กรกฎาคม ๒๕๖๘.....

ผู้เข้าร่วมฝึกอบรม/สัมมนา หรือศึกษาต่อ (จำนวน ความรู้ ภาษา).....จำนวน ๓๐ คน.....

วัตถุประสงค์และเนื้อหาของหลักสูตร

.....หลักสูตร Macroeconometric Forecasting and Analysis มีวัตถุประสงค์เพื่อให้ผู้ร่วมฝึกอบรมได้เรียนรู้เกี่ยวกับการประมาณการแบบจำลองเศรษฐกิจเชิงมหภาค และการประยุกต์ใช้ในการวิเคราะห์เศรษฐกิจระยะสั้น (Nowcasting) การประมาณการเศรษฐกิจ (Forecasting) และการวิเคราะห์เชิงนโยบาย หลักสูตรครอบคลุมการศึกษาแบบจำลองเชิงเศรษฐกิจ ทั้งในรูปแบบตัวแปรเดียว (Univariate) และหลายตัวแปร (Multivariate) แบบจำลองเชิงโครงสร้างสถานะ (State-space Models) รวมถึงเทคนิคการวิเคราะห์เศรษฐกิจระยะสั้น เช่น BRIDGE MIDAS UMIDAS เป็นต้น โดยในแต่ละหัวข้อจะประกอบด้วยการบรรยายเชิงทฤษฎี และการฝึกปฏิบัติผ่านโปรแกรม EViews

ประโยชน์ที่ได้รับ

.....ได้รับความรู้พื้นฐานและขั้นสูงในการประมาณการแบบจำลองเศรษฐกิจเวลาชุดข้อมูล (Time Series) ซึ่งสามารถนำไปประยุกต์ใช้กับข้อมูลทางเศรษฐกิจจริงได้อย่างมีประสิทธิภาพ และได้เรียนรู้จาก การทดลองใช้เครื่องมือและแบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคผ่านโปรแกรม EViews รวมถึงการฝึกปฏิบัติเชิงสถิติ ด้านการประมาณการเศรษฐกิจผ่านแบบจำลองและการประมาณการเชิงประจักษ์ที่แตกต่างกันตามลักษณะของ ข้อมูล และเรียนรู้แนวทางในการวิเคราะห์ข้อมูลเชิงเศรษฐกิจอย่างเป็นรูปธรรม

การนำมาใช้ในการปฏิบัติงาน

.....สามารถนำความรู้และทักษะที่ได้จากการฝึกอบรมนำมาประยุกต์ใช้สำหรับการประมาณการเศรษฐกิจ ให้มีความแม่นยำมากยิ่งขึ้น และสามารถประยุกต์ใช้แบบจำลองที่เรียนรู้จากการเข้าฝึกอบรมมาพัฒนา การประมาณการเศรษฐกิจให้ครอบคลุมและแม่นยำมากยิ่งขึ้น โดยสามารถพิจารณาตัวแปรในแบบจำลอง เพื่อพิจารณาปัจจัยที่อาจมีผลต่อการเติบโตของเศรษฐกิจและแนวโน้มของการเปลี่ยนแปลงของปัจจัยที่อาจมีผลต่อ เศรษฐกิจ ทั้งนี้ หลักสูตรดังกล่าวได้เพิ่มทักษะและความรู้เกี่ยวกับแบบจำลองเศรษฐกิจมหภาคมากขึ้น โดยในอนาคตจะสามารถนำความรู้และทักษะดังกล่าวมาประยุกต์ใช้ในการประมาณการทางเศรษฐกิจในแง่มุม ต่าง ๆ ได้ นอกจากนี้ ยังได้เพิ่มทักษะและความชำนาญในการใช้แบบจำลองผ่านเครื่องมือของโปรแกรม EViews ให้มีประสิทธิภาพมากยิ่งขึ้น

วันกลับเข้าปฏิบัติราชการ.....วันจันทร์ที่ ๗ กรกฎาคม ๒๕๖๘.....

รายงานสรุปผลการเข้าร่วมฝึกอบรม/สัมมนา หรือ ศึกษาต่อ ณ ต่างประเทศ

ชื่อ นายธัญญ์ พวงนวม ตำแหน่ง เศรษฐกรชำนาญการ

กอง นโยบายเศรษฐกิจมหภาค

ชื่อหลักสูตร/สาขา Macroeconometric Forecasting and Analysis

แหล่งทุน กองทุนการเงินระหว่างประเทศ (International Monetary Fund: IMF)

สถานที่ สาธารณรัฐสิงคโปร์

ระยะเวลา ๒๓ มิถุนายน - ๔ กรกฎาคม ๒๕๖๘

ผู้เข้าร่วมฝึกอบรม/สัมมนา หรือศึกษาต่อ (จำนวน ความรู้ ภาษา) จำนวน ๓๒ คน จากกระทรวงการคลังและธนาคารกลางของประเทศต่าง ๆ เช่น สาธารณรัฐสิงคโปร์ สาธารณรัฐอินโดนีเซีย สาธารณรัฐฟิลิปปินส์ ราชอาณาจักรกัมพูชา สาธารณรัฐประชาชนบังกลาเทศ สาธารณรัฐประชาธิปไตยประชาชนลาว สาธารณรัฐมัลดีฟส์ สาธารณรัฐฟีจี สาธารณรัฐอิสลามปากีสถาน เป็นต้น

วัตถุประสงค์และเนื้อหาของหลักสูตร

การอบรมหลักสูตร Macroeconometric Forecasting and Analysis มีวัตถุประสงค์เพื่อให้ผู้เข้ารับการฝึกอบรมสามารถอธิบาย วิเคราะห์ เปรียบเทียบลักษณะและข้อจำกัดของแบบจำลองทางเศรษฐมิติประเภทต่าง ๆ เช่น ARIMA Vector autoregression (VAR) Bayesian VARs Vector Error Correction Models (VECM) เป็นต้น รวมถึงแบบจำลองเพื่อคาดการณ์เศรษฐกิจปัจจุบัน (Nowcasting) ได้แก่ BRIDGE MIDAS และ U-MIDAS สำหรับนำมาประยุกต์ใช้ในการจัดทำประมาณการเศรษฐกิจผ่านการประยุกต์ใช้โปรแกรม EViews โดยหลักสูตรดังกล่าวประกอบเนื้อหาของหลักสูตรที่สำคัญ ดังนี้

๑. Overview of Macroeconomic forecasting
๒. Properties of time series data I: Stationarity and Box - Jenkins ARIMA models
๓. Properties of time series data II: non-stationarity and unit roots
๔. Vector autoregression (VAR): formulation estimation hypothesis testing and forecasting
๕. Structural VARs impulse response function and variance decomposition
๖. Bayesian models and Bayesian VARs (BVARs) I
๗. Bayesian Models and Bayesian VARs (BVARs) II
๘. Cointegration I: Single equation estimation error correction models and forecasting
๙. Cointegration II: Johansen methodology
๑๐. Evaluating forecasts and forecast combinations
๑๑. Nowcasting (BRIDGE MIDAS and U - MIDAS)
๑๒. State space models representation of dynamic models
๑๓. Forecasting and smoothing using the Kalman filter

ประโยชน์ที่ได้รับ

การเข้าร่วมฝึกอบรมหลักสูตรดังกล่าวทำให้ได้รับประโยชน์ในการวิเคราะห์และคาดการณ์ตัวแปรทางเศรษฐกิจมหภาคได้ รวมถึงเข้าใจองค์ประกอบของข้อมูลเศรษฐกิจมหภาคเชิงลึก ความผันผวนของข้อมูล ทิศทางของข้อมูล การทดสอบทางสถิติที่สำคัญ การเชื่อมโยงหาความสัมพันธ์ของตัวแปรต่าง ๆ รวมถึงการจัดความผันผวนเพื่อทำให้ตัวแปรมีความนิ่งและเตรียมพร้อมสำหรับการคาดการณ์ด้วยแบบจำลองต่าง ๆ ต่อไป การเลือกใช้แบบจำลองให้เหมาะสมตามหลักวิชาการ การทดสอบความแม่นยำเพื่อคาดการณ์ และการเลือกแบบจำลองที่แม่นยำที่สุดในการคาดการณ์หลังจากการทดสอบผลทางสถิติ ซึ่งจะเป็นพื้นฐานความรู้ที่ดีและสนับสนุนการทำงานจริงในด้านการคาดการณ์เศรษฐกิจมหภาคต่อไป.....

การนำมาใช้ในการปฏิบัติงาน

บทเรียนต่าง ๆ ในการฝึกอบรมสามารถนำมาประยุกต์ใช้ในการดำเนินงานของกองนโยบายเศรษฐกิจมหภาคได้โดยตรง เริ่มต้นจากการสร้างพื้นฐานความเข้าใจในข้อมูลเศรษฐกิจมหภาค รูปแบบของทิศทางและความผันผวนของข้อมูล องค์ความรู้ในการวิเคราะห์และคาดการณ์เศรษฐกิจด้วยเศรษฐกิจมิติ การจัดความผันผวนให้ข้อมูลมีความนิ่ง รวมทั้งการประเมินผลลัพธ์ของแบบจำลองต่าง ๆ เพื่อนำไปสู่การเลือกแบบจำลองที่มีประสิทธิภาพสูงที่สุด สิ่งเหล่านี้จะช่วยสนับสนุนให้การคาดการณ์ตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคต่าง ๆ ที่กองนโยบายเศรษฐกิจมหภาคได้ดำเนินการประมาณการเศรษฐกิจไทยในทุกไตรมาส สามารถทำได้อย่างมีประสิทธิภาพ แม่นยำ ทันสมัย และถูกต้องตามหลักวิชาการ.....

วันกลับเข้าปฏิบัติราชการ ๗ กรกฎาคม ๒๕๖๘.....



COURSE ON MACROECONOMETRIC FORECASTING AND ANALYSIS
JUNE 23 – JULY 4, 2025
SINGAPORE



Front Row (L-R) : Siwaphon Phromwong, Nabila Fahria, Nomuundari Chimed-Yunden, Tugrul Vehbi, Paul Cashin, Victor Pontines, Sam Ouliaris, Dorothy Jane Monsalud Obispo, Sereiroth Bunthan

Middle Row (L-R) : Katie Josiah Longe'au, Sovanney Chey, Shahista Zahara Bano, Hafsa Naeem, Kamal Kanta Poudel, Batbayar Baatarkhuu, Jonathan Wak, Phoutsavanh Bouphavanh, Muhammad Afiq Bin Abdul Wahid, Jazlee Wee Jia Li, Aaron Goh Zhong Fu, Hina Masood, Tselmeg Batbayar, Preychea Priyalen

Back Row (L-R) : Tanut Puangnuam, Muhammad Fajar Nugraha, Kevin Daniel Maniago Quizon, Soo Zhan Hui, Lim Zheng Sen Joel, Avelino Maria de Jesus Marçal, Khoo Ye-Min, Ansar Abbas Ali, Tien Dat Dang, Irwan Sutisna, Emilio Santiago Razon Artadi, Mohamed Shaneez Abdul Latheef