

## รายงานสรุปผลการเข้าร่วมฝึกอบรม/สัมมนา หรือ ศึกษาต่อ ณ ต่างประเทศ

ชื่อ.....ชานน ลิ้มปรีประสิทธิ์พร.....ตำแหน่ง.....เศรษฐกรชำนาญการ.....

สำนัก.....กองนโยบายเศรษฐกิจมหภาค (กศม.).....

ชื่อหลักสูตร/สาขา.....In-Person : Macroeconometric Forecasting and Analysis.....

แหล่งทุน.....กองทุนการเงินระหว่างประเทศ.....

สถานที่.....สหรัฐอเมริกา.....

ระยะเวลา.....๔ - ๑๕ พฤศจิกายน ๒๕๖๗.....

ผู้เข้าร่วมฝึกอบรม/สัมมนา หรือศึกษาต่อ (จำนวน ความรู้ ภาษา) จำนวนผู้เข้าร่วม 40 คน ซึ่งเป็นผู้ที่มีความรู้หรือประสบการณ์ทางด้านเศรษฐกิจมหภาคและการคาดการณ์ โดยใช้ภาษาอังกฤษในการอบรม  
วัตถุประสงค์และเนื้อหาของหลักสูตร

คอร์สเรียน Macroeconometric Forecasting and Analysis ได้นำเสนอโดยทีม Macro-Modeling & Monetary Division ซึ่งได้ช่วยให้ผู้เข้าร่วมมีองค์ความรู้ในการคาดการณ์เศรษฐกิจมหภาคและสามารถวิเคราะห์ประเด็นเศรษฐกิจมหภาคได้อย่างลึกซึ้ง มีการนำแบบจำลองเศรษฐกิจรูปแบบต่าง ๆ เข้ามาร่วมในการคาดการณ์ เช่น ARIMA, Vector autoregression (VAR), Bayesian VARs, Vector Error Correction Models (VECM) รวมถึงมีแบบจำลองเพื่อคาดการณ์เศรษฐกิจปัจจุบัน (Nowcasting) เช่น BRIDGE, MIDAS, และ U-MIDAS

ประโยชน์ที่ได้รับ การเข้าร่วมฝึกอบรมทำให้ได้รับประโยชน์ในการวิเคราะห์และคาดการณ์ตัวแปรทางเศรษฐกิจมหภาคได้ รวมถึงเข้าใจองค์ประกอบของข้อมูลเศรษฐกิจมหภาคเชิงลึก ความผันผวนของข้อมูลทิศทางของข้อมูล การทดสอบทางสถิติที่สำคัญ การเชื่อมโยงความสัมพันธ์ของตัวแปรมหภาคต่าง ๆ รวมถึงการจัดความผันผวนเพื่อให้ตัวแปรมีความนิ่งเตรียมพร้อมสำหรับการคาดการณ์ด้วยแบบจำลองต่าง ๆ ต่อไป การเลือกใช้แบบจำลองให้เหมาะสมตามหลักวิชาการ การทดสอบความแม่นยำเพื่อคาดการณ์ และการเลือกแบบจำลองที่แม่นยำที่สุดในการคาดการณ์หลังจากการทดสอบผลทางสถิติ สิ่งเหล่านี้จะเป็นพื้นฐานความรู้ที่ดีมากและสนับสนุนการทำงานจริงในด้านการคาดการณ์เศรษฐกิจมหภาคต่อไป

### การนำมาใช้ในการปฏิบัติงาน

บทเรียนต่าง ๆ ในการฝึกอบรมสามารถนำมาประยุกต์ใช้ในการดำเนินงานของ กศม. ได้โดยตรง เริ่มต้นจากการสร้างพื้นฐานความเข้าใจในข้อมูลเศรษฐกิจมหภาค รูปแบบของทิศทางและความผันผวนของข้อมูล องค์ความรู้ในการวิเคราะห์และคาดการณ์เศรษฐกิจด้วยเศรษฐกิจมิติ การจัดทำความผันผวนให้ข้อมูลมีความนิ่ง รวมทั้งการประเมินผลลัพธ์ของแบบจำลองต่าง ๆ เพื่อนำไปสู่การเลือกแบบจำลองที่มีประสิทธิภาพสูงที่สุด สิ่งเหล่านี้จะช่วยสนับสนุนให้การคาดการณ์ตัวแปรเศรษฐกิจมหภาคต่าง ๆ ที่ กศม. ได้ดำเนินการประมาณการเศรษฐกิจไทยในทุกไตรมาส สามารถทำได้อย่างมีประสิทธิภาพแม่นยำ ทันสมัย และถูกต้องตามหลักวิชาการ

วันกลับเข้าปฏิบัติราชการ ๑๘ พฤศจิกายน ๒๕๖๗