

|   |    |
|---|----|
| <b>1 Einführung und Überblick</b> .....   | 1  |
| Vaibhavi Aher   |    |
| Maschinen-generierte Zusammenfassungen .....  | 1  |
| „Entlang der Kurven“: Überbrückung der Kluft zwischen vergleichender Statistik und simultanen ökonometrischen Modellen .....  | 1  |
| Modellierung historischer US-Zeitreihenpreise und der Inflation unter Verwendung alternativer Ansätze mit langem Gedächtnis .....   | 4  |
| Ein einfacher Wavelet-basierter Test für serielle Korrelation in Paneldatenmodellen .....   | 7  |
| Versteckspiel mit Zeitreihenfiltern: Eine modellbasierte Monte-Carlo-Studie .....   | 10 |
| Ein ARFIMA-Mehrebenenmodell für Zwei-Komponenten-Erwartungen in wiederholten Querschnittserhebungsdaten .....   | 13 |
| Untersuchung der Umwelt-Kuznets-Kurve für Schweden: Erkenntnisse aus multivariaten adaptiven Regressionssplines (MARS). ....  | 16 |
| Wie Messfehler die Schlussfolgerungen bei der linearen Regression beeinflussen. ....  | 18 |
| Switching-Regime-Regression zur Modellierung und Vorhersage einer Aktienmarkttendite .....  | 22 |
| Einige grundlegende Fragen der Zeitreihenmodellierung .....   | 24 |
| Langfristige Vorhersageintervalle von wirtschaftlichen Zeitreihen .....   | 26 |
| Erforschung der Dynamik des Bitcoin-Preises: Ein bayesianischer Ansatz für strukturelle Zeitreihen .....  | 29 |
| Gini-PLS-Regressionen .....   | 34 |
| Über einige Charakterisierungen von Wahrscheinlichkeitsverteilungen mit Anwendungen in der Ökonometrie: Eine Hommage an CR Rao zum 100. Geburtstag .....                  | 36 |
| Die Rolle der Nichtlinearität bei der Verknüpfung von finanzieller Entwicklung und wirtschaftlicher Leistung: Eine ökonometrische Anwendung auf italienische Banken ..... | 39 |

---

|  |           |
|--|-----------|
| Ökonometrische Geschichte der Beziehung zwischen Wachstum und Volatilität in den USA: 1919–2017 . . . . .  | 42        |
| Software-illustrierte Erklärungen zur Ökonometrie – Beiträge von CR Rao zu seinem 100. Geburtstag . . . . .  | 44        |
| Penalisierungsmethoden mit gruppenweiser Sparsamkeit: Ökonometrische Anwendungen auf Online-Auktionen von eBay Motors . . . . .  | 48        |
| Ein makroökonometrisches VAR-Modell für Indien, das das Einkommen der Schwarzen Menschen berücksichtigt . . . . .  | 50        |
| Politisches Risiko und reale Wechselkurse: Was können wir aus den jüngsten Entwicklungen in der Paneldaten-Ökonometrie für Schwellen- und Entwicklungsländer lernen? . . . . . | 53        |
| Einige Tendenzen in der modernen Ökonometrie . . . . .   | 56        |
| Beeinflussen Vorstände die Vergütung von Führungskräften in indischen Banken? Eine ökonometrische Untersuchung . . . . .   | 58        |
| Dynamische Wechselwirkungen zwischen Struktur und Leistung in der Textil- und Bekleidungsindustrie in Indien: Ein ökonometrischer Ansatz . . . . .                             | 61        |
| Literatur . . . . .  | 65        |
| <b>2 Analyse . . . . .</b>   | <b>73</b> |
| Vaibhavi Aher  |           |
| Maschinen-generierte Zusammenfassungen . . . . .   | 73        |
| Disaggregierung der Auswirkungen der Ölpreise auf die europäischen Industrieaktienindizes: Eine räumliche ökonometrische Analyse . . . . .                                     | 73        |
| Zensierte nichtparametrische Zeitreihenanalyse mit autoregressiven Fehlernmodellen . . . . .   | 76        |
| Analyse von Wirtschaftswachstum und Gesundheitsausgaben in der Türkei: Beweise aus Zeitreihen . . . . .  | 80        |
| Besteht wirklich ein Zusammenhang zwischen Fruchtbarkeit und Erwerbsbeteiligung von Frauen? Perspektiven aus der Zeitreihenanalyse . . . . .                                   | 83        |
| Zeitreihenanalyse der Renditen und Volatilitäten von Kryptowährungen . . . . .   | 85        |
| Prüfung der Hypothese „Angst vor dem Flottmachen“: Eine statistische Analyse für acht afrikanische Länder . . . . .  | 88        |
| Auswirkungen von Umweltvorschriften auf die Luftreinhaltung in China: Eine räumlich-ökonometrische Analyse nach Durbin . . . . .   | 91        |
| Prüfung der Konvergenzhypothese: Eine Längs- und Querschnittsanalyse des Welthandelsnetzes mittels sozialer Netzwerke und statistischer Analysen . . . . .                     | 94        |
| Einführung in fortgeschrittene statistische Analysen für computergestützte Wirtschafts- und Finanzsysteme . . . . .  | 98        |
| Analyse der Auswirkungen von Gebieten mit besonderen rechtlichen Regelungen auf die regionale Entwicklung Russlands: Ein ökonometrischer Ansatz . . . . .                      | 99        |
| Eine ökonometrische Analyse der brasilianischen Fusionspolitik . . . . .   | 100       |

---

|   |            |
|---|------------|
| Ähnlich, aber speziell: Eine ökonometrische Analyse der Besucherzahlen von Live-Darbietungen in Festlandchina . . . . .   | 103        |
| Determinanten ausländischer Direktinvestitionen an der südlichen Zentralküste Vietnams: Eine räumlich-ökonometrische Analyse . . . . .  | 106        |
| Ist die Gesetzgebung Schmiermittel oder Sand für das Wirtschaftswachstum? Eine ökonometrische Analyse anhand von Daten aus italienischen Regionen vor und nach der Krise von 2008 . . . . . | 110        |
| Ökonometrische Analyse des Zusammenhangs zwischen Defizitfinanzierungsoptionen und Wachstumsinklusion in Indien und Nigeria . . . . .   | 113        |
| Die regionale Heterogenität des Haushaltsrecyclings: Eine räumlich-ökonometrische Analyse von schwedischen Kunststoffverpackungsabfällen . . . . .  | 116        |
| Determinanten der landwirtschaftlichen Diversifizierung in Brasilien: Eine räumlich-ökonometrische Analyse . . . . .  | 119        |
| Die Auswirkungen der Kreditvergabe der Banken auf das Wirtschaftswachstum in Palästina: Eine ökonometrische Analyse von Zeitreihendaten . . . . .   | 122        |
| Divergenz der Erfindungsbemühungen im Bereich der erneuerbaren Energien in Europa: Eine ökonometrische Analyse auf der Grundlage von Patentzahlen . . . . .                                 | 124        |
| Grüne Industriepolitik und inländische Produktion von Biokraftstoffen: Eine ökonometrische Analyse der OECD-Länder . . . . .  | 127        |
| Literatur . . . . .   | 131        |
| <b>3 Schätzung . . . . .</b>  | <b>137</b> |
| Vaibhavi Aher   |            |
| Maschinen-generierte Zusammenfassungen . . . . .  | 137        |
| Implementierung exogener Szenarien in ein globales MRIO-Modell zur Schätzung künftiger ökologischer Fußabdrücke . . . . .   | 137        |
| Sind Zentralbanker Inflationsversteher? Ein MCMC-Schätzer für den Langspeicherparameter in einem Zustandsraummodell . . . . .   | 140        |
| Verallgemeinerter Bayes-Schätzer für das räumliche Durbin-Modell . . . . .  | 143        |
| Schätzung eines dynamischen Faktormodells in EViews unter Verwendung des Kalman-Filters und des Smoother . . . . .  | 144        |
| Multivariate Regime-Switching-Modell-Schätzung und Vermögensallokation . . . . .  | 147        |
| Bayes'sche Schätzung und likelihood-basierter Vergleich von agentenbasierten Volatilitätsmodellen . . . . .   | 150        |
| Verbesserung der Inflationsprognose für Nigeria anhand des Ölpreises: Die Rolle der Schätzer . . . . .  | 153        |

---

|   |            |
|---|------------|
| Strukturbrüche, verzerrte Schätzungen und Prognosefehler in einer BIP-Reihe für Kanada und die Vereinigten Staaten . . . . .  | 156        |
| Eine empirische Anmerkung zur Schätzung und Vorhersage der Volatilität lateinamerikanischer Devisenrenditen: Die Rolle von Komponenten mit langem Gedächtnis und zufälligen Niveauverschiebungen . . . . .        | 159        |
| Vorhersage in Big-Data-Umgebungen: Eine anpassungsfähige und automatisierte Schätzung der Schrumpfung neuronaler Netze (AASHNet) . . . . .  | 161        |
| Ungenaue Value-at-Risk-Schätzungen: Schlechte Modellierung oder ungeeignete Daten? . . . . .  | 164        |
| Bayes'sche Schätzung des hierarchischen SLX-Modells mit einer Anwendung auf Wohnungsmärkte . . . . .  | 167        |
| Die Determinanten der individuellen Gesundheitsausgaben in der italienischen Region Friaul-Julisch Venetien: Erkenntnisse aus einer hierarchischen räumlichen Modellschätzung . . . . .                           | 170        |
| Überarbeitung der Schätzmethoden für räumlich-ökonometrische Interaktionsmodelle . . . . .  | 174        |
| Gleichzeitige Berücksichtigung von räumlicher Heterogenität und räumlicher Autokorrelation in der europäischen Innovation: Ein räumlich-ökonometrischer Ansatz auf der Grundlage der MGWR-SAR-Schätzung . . . . . | 177        |
| Literatur . . . . .   | 180        |
| <b>4 Ausblick . . . . .</b>   | <b>185</b> |
| Vaibhavi Aher   |            |
| Maschinen-generierte Zusammenfassungen . . . . .  | 185        |
| Vorhersage von Rezessionen mittels dynamischem Probit für Zeitreihen: Replikation und Erweiterung von Kauppi und Saikkonen (2008) . . . . .   | 185        |
| Vorhersage von Finanzstress-Indizes in Korea: Ein Faktorenmodell-Ansatz . . . . .   | 188        |
| Das arbitragefreie verallgemeinerte Nelson-Siegel-Termstrukturmodell: Führt eine gute Anpassung innerhalb der Stichprobe zu besseren Prognosen außerhalb der Stichprobe? . . . . .                                | 191        |
| Zusammengesetzte Vorhersage von großdimensionalen realisierten Kovarianzmatrizen unter Verwendung von Faktor-Zustandsraum-Modellen . . . . .  | 194        |
| Vorhersage von Aktienmarktbewegungen anhand von Google Trend-Suchen . . . . .   | 197        |
| Vorhersage von Baugenehmigungen mit Google Trends . . . . .   | 200        |
| Vorhersage des Produktionswachstums mit Hilfe einer DSGE-basierten Zerlegung der südafrikanischen Renditekurve . . . . .  | 203        |
| Messung der Kerninflation in China für Prognosezwecke: Persistenz als Gewicht . . . . .   | 205        |

---

|   |     |
|---|-----|
| Prognosemodelle für die chinesische Makroökonomie: Je einfacher, desto besser? .....  | 208 |
| Vorhersageleistung von Nowcasting- und Prognosemodellen mit gemischten Frequenzen (mit Anwendung auf die philippinische Inflation und das BIP-Wachstum) .....           | 211 |
| Inflationsprognose für den Euroraum: Auf die Länder kommt es an! .....  | 214 |
| Die Rolle der zeitlichen Abhängigkeit bei der Faktorauswahl und der Ölpreisprognose .....   | 217 |
| Vorläufige Prognosen bei Vorliegen von Strukturbrüchen auf den Erdgas-Spotmärkten .....   | 220 |
| Ist es möglich, die Entwicklung der Brent-Rohölpreise genau vorherzusagen? Eine Antwort auf der Grundlage parametrischer und nichtparametrischer Prognosemethoden ..... | 223 |
| Vorhersage der Ausfuhren in Europa: Welches sind die besten Umfrageindikatoren? .....   | 225 |
| Konjunkturdaten und -prognosen mit Echtzeitdaten zum Schweizer BIP ..   | 228 |
| Vorhersage des realen türkischen BIP-Wachstums in einem datenreichen Umfeld .....   | 231 |
| Umfangreiche Modellierung von Einkommens- und Vermögenseffekten: Eine Prognose für den privaten Verbrauch im Euroraum .....   | 233 |
| Schwellenwert-Mixed-Data-Sampling-Regressionsmodelle (TMIDAS) mit einer Anwendung auf BIP-Prognosefehler .....  | 237 |
| Vorhersageleistung von Bayes'schen VEC-MSF-Modellen für Finanzdaten bei Vorhandensein langfristiger Beziehungen .....   | 239 |
| Statistische und ökonomische Bewertung von Zeitreihenmodellen zur Vorhersage von Anrufen in Callcentern .....   | 242 |
| Makroökonometrische Prognosen unter Verwendung eines Clusters dynamischer Faktormodelle .....   | 245 |
| Literatur .....   | 247 |