

1 Einführung und Überblick	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 Aktienmarkttrendite	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 makroökonomisches 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
2 Analyse	73
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 Fehlermodellen	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 Patenzahlen	124
Grüne Industriepolitik und inländische Produktion von Biokraftstoffen: Eine ökonometrische Analyse der OECD-Länder	127
Literatur.	131
3 Schätzung.	137
Vaibhavi Aher	
Maschinen-generierte Zusammenfassungen.	137
Implementierung exogener Szenarien in ein globales MRIO-Modell zur Schätzung künftiger ökologischer Fußabdrücke.	137
Sind Zentralbanker Inflationsversther? 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
Ungenauere 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-ökonomische Interaktionsmodelle.	174
Gleichzeitige Berücksichtigung von räumlicher Heterogenität und räumlicher Autokorrelation in der europäischen Innovation: Ein räumlich-ökonomischer Ansatz auf der Grundlage der MGWR-SAR-Schätzung	177
Literatur.	180
4 Ausblick	185
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
Makroökonomische Prognosen unter Verwendung eines Clusters dynamischer Faktormodelle	245
Literatur.	247