

Lehrstuhl für Statistik und Ökonometrie

**Justus-Liebig-Universität Gießen
Prof. Dr. Peter Winker**

Forschungsbericht 2019

- 1. Laufende und in 2019 abgeschlossene Forschungsprojekte**
- 2. Internationale Kooperationen und Gäste**
- 3. Publikationen**
- 4. Vorträge und Konferenzen**
- 5. Sonstiges**

1. Laufende und in 2019 abgeschlossene Forschungsprojekte

Empirische Makroökonomik

- Nichtlineare Zeitreihenmodelle zur Prognose makroökonomischer Zeitreihen
- Konstruktion von Bootstrap-Konfidenzbändern für Prognosen und Impulse Antwort Folgen in linearen und nicht-linearen Modellen
- Einsatz von textbasierten Indikatoren in Zeitreihenmodellen

Heuristische Optimierung in Ökonometrie und Statistik

- Automatisierte Modellauswahl in VAR-, VEC- und dynamischen Paneldatenmodellen
- Konstruktion optimierter experimenteller Designs für Order of Addition Experimente

Text basierte Indikatoren und deren Einsatz in ökonometrischen Modellen

- Verbundvorhaben TOBI (Textdaten-basierte Output-Indikatoren als Basis einer neuen Innovationsmetrik) – BMBF gefördertes Kooperationsvorhaben (Koordinator: ZEW, Mannheim)
- Text-Mining von ad hoc Mitteilungen

Sonstige

- Verbundvorhaben REdMig (Nicht-monetäre Bildungserträge in Form sozialer Einbindung: Schätzung und Zusammenspiel privater und gesellschaftlicher Bildungserträge von Menschen mit und ohne Migrationshintergrund) – BMBF gefördertes Kooperationsvorhaben (Koordinator: Universität Hamburg)
- Identifikation von Fälschungen in Umfragen
- Anwendungen von Intervalldatenmodellen im Bereich Marktforschung

2. Kooperationen und Gäste

Gäste:

- Dr. Milica Maricic, Universität Belgrad, 21.10.2019 – 1.11.2019: Konstruktion von zusammengesetzten Indikatoren
- Alessandro Grimaldi, Universität Salerno, 8.11.2019 – 21.12.2019: Textmining von Parlamentsreden

Kooperationen:

- Prof. Dr. Lutz Breuer, JLU (seit 2015): Einsatz von Zeitreihenverfahren und heuristischen Optimierungsverfahren zur Modellierung von Wasserhaushalten
- Prof. Dr. Dr. h.c. Ingrid Gogolin, Universität Hamburg (seit 2015): Nicht-monetäre Bildungserträge
- Prof. Dr. Alexander Haas, JLU (seit 2015): Anwendungen von Intervalldatenmodellen im Bereich Marktforschung
- Dr. Marina Langemann, Universität Hamburg (seit 2015): Nicht-monetäre Bildungserträge.
- Dr. Georg Licht, ZEW (seit 2017): Textdaten-basierte Output-Indikatoren als Basis einer neuen Innovationsmetrik.
- Prof. Dr. Ingo Liefner, Universität Hannover (seit 2013): Regionalökonomische Effekte der Hochschulen am Standort Gießen und Absolventenstudie
- Prof. Dennis Lin, Pennsylvania State University (seit 2008): Uniform Design und Anwendungen
- Prof. Dr. Helmut Lütkepohl, FU Berlin und DIW (seit 2012): Konstruktion von Konfidenzbändern für VAR-Modelle
- Prof. Dr. Natalja Menold, TU Dresden (seit 2009): Identifikation von Fälschungen in Umfragedaten
- Prof. Dr. Bernhard Nauck, Universität Chemnitz (seit 2015): Nicht-monetäre Bildungserträge
- Dr. Anna Staszewska, Universität Lodz (seit 2010): Konstruktion optimaler Konfidenzbänder für VAR-Modelle und Prognosen
- Prof. Dr. Peter Tillmann, JLU (seit 2011): Einsatz neuer ökonometrischer Verfahren zur Analyse von Inflationsprognosen

3. Publikationen

Referierte Fachzeitschriften

S.B. Bruns, I. Asanov, R. Bode, M. Dunger, **C. Funk** S.M. Hassan, J. Hauschildt, D. Heinisch, K. Kempa, J.König, **J. Lips**, M. Verbeck, E. Wolfschütz, G. Buenstorf (2019): “Reporting Errors and Biases in Published Empirical Findings: Evidence from Innovation Research, Research Policy, 48,9, 2019, 103796 (<https://doi.org/10.1016/j.respol.2019.05.005>).

C. Funk, A.R. Sathyan, **P. Winker** und L. Breuer (2019): ”Changing Climate - Changing Livelihood: Smallholder’s Perceptions and Adaption Strategies”, Journal of Environmental Management, in press, doi.org/10.1016/j.jenvman.2019.109702

D. Grabowski, A. Staszewska-Bystrova und **P. Winker** (2019): “Skewness-Adjusted Bootstrap Confidence Intervals and Confidence Bands for Impulse Response”, Functions AStA Advances in Statistical Analysis, doi.org/10.1007/s10182-018-00347-9.

M. Lagemann und **P. Winker** (2019): “Soziale Kosten von Bildungsaspirationen bei Sekundarstufenschüler(inne)n ohne und mit Migrationshintergrund: Wenn die eigenen Aspirationen nicht denen der Freundinnen und Freunde entsprechen“, Zeitschrift für Erziehungswissenschaft, 22, 203–233, doi.org/10.1007/s11618-019-00884-2.

J. Lips (2019): “Debt and the Oil Industry: Analysis on the Firm and Production Level”, Journal of Energy Markets, <https://doi.org/10.21314/jem.2019.189>.

H. Lütkepohl, A. Staszewska-Bystrova und **P. Winker** (2019): “Constructing Joint Confidence Bands for Impulse Response Functions of VAR Models – A Review”, Econometrics and Statistics, forthcoming.

Diskussionspapiere

J. Kinne und **D. Lenz** (2019): “Predicting Innovative Firms using Web Mining and Deep Learning”, ZEW Discussion Paper No. 19-001, ZEW, Mannheim.

4. Vorträge und Konferenzen

Mitarbeiter	Konferenz/Forschungsseminar	Vortrag
Christoph Funk	3rd Australasian Commodity Markets Conference, 4.-5.4.2019, Sydney	Oil Price Shocks and Debt in the Oil Industry - An Empirical Analysis
David Lenz	Seminar, Deutsche Bundesbank, Frankfurt a.M, 3.4.2019	Predicting Innovative Firms using Web Mining and Deep Learning

Peter Winker	CRoNoS meeting, Limassol, Cyprus, 15.4.2019	Comparing the relevance of topics in economic journals
Peter Winker	CRoNoS spring course, Limassol, Cyprus, 15.4.2019	Tutorial on Text Mining in Econometrics
Peter Winker	WWZ Research Seminar, Universität Basel, 14.5.2019	Is text the New Data? First Experience with Conference Abstracts
Johannes Lips	7th International Symposium on Environment and Energy Finance Issues (ISEFI-2019), 24.5.2019, Paris	Oil Price Shocks and Cost of Debt - Evidence from U.S. Oil Firms
Peter Winker	Forschungskolloquium Wirtschaftswissenschaften, Universität Konstanz, 25.6.2019	Is text the New Data? First Experience with Conference Abstracts
David Lenz	Seminar, International Business School Brandeis University, Waltham, MA, 8.7.2019	Predicting Innovative Firms using Web Mining and Deep Learning
David Lenz	LISH Harvard University Seminar, Cambridge, MA, 16.7.2019	Predicting Innovative Firms using Web Mining and Deep Learning
Christoph Funk	16th IAEE European Conference, 25.-28.8.2019, Ljubljana	Oil Price Shocks and Cost of Debt - Evidence from US Oil firms
David Lenz	Workshop Webscraping, Statistisches Bundesamt, Wiesbaden, 25.9.2019	Predicting Innovative Firms using Web Mining and Deep Learning
Peter Winker	13th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2019/CMStatistics 2019), London, 16.12.2019	Keynote Talk: Text as a New Source of Data: First Experience with Conference Abstracts

5. Sonstiges

seit Jan. 2005 ist Peter Winker Mitherausgeber der "Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik", seit Jan. 2008 ist er geschäftsführender Herausgeber

seit Februar 2007 ist Peter Winker Mitglied im Ausschuss für Ökonometrie des Vereins für Socialpolitik

seit März 2007 ist Peter Winker Co-Chair der Specialized Group „Optimization Heuristics in Estimation and Modelling“ der ERCIM Working Group Computing and Statistics.

seit Februar 2009 ist Peter Winker Associate Editor von “Central European Journal of Economic Modelling and Econometrics“

seit März 2009 ist Peter Winker Mitherausgeber der Schriften zur Empirischen Wirtschaftsforschung im Peter Lang Verlag

seit Oktober 2009 ist Peter Winker Associate Editor of Computational Management Science

seit November 2011 ist Peter Winker elected member of the International Statistical Institute (ISI)

seit 2016 ist Peter Winker gewähltes Mitglied des Fachkollegiums Wirtschaftswissenschaften der DFG

seit 2016 ist Peter Winker Associate Editor of Econometrics and Statistics

seit 2018 ist Peter Winker Mitglied des Aufsichtsrats des ZEW, Mannheim

seit 2018 ist Peter Winker gewähltes Mitglied des wissenschaftlichen Beirats von GESIS, Leibniz-Institut für Sozialwissenschaften

2018 – 2020 ist Peter Winker Chairman des Executive Committee des ERS - Board of Directors der IASC - International Association for Statistical Computing im ISI