

Lehrstuhl für Statistik und Ökonometrie

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

Forschungsbericht 2006

- 1. Laufende und in 2006 abgeschlossene Forschungsprojekte**
- 2. Internationale Kooperationen und Gäste**
- 3. Publikationen**
- 4. Vorträge und Konferenzen**
- 5. Sonstiges**

1. Laufende und in 2006 abgeschlossene Forschungsprojekte

Empirische Makroökonomik

- Nichtlineare Zeitreihenmodelle zur Prognose makroökonomischer Zeitreihen
- Aggregationsprobleme
- Ökonometrische Implikationen der Arbeit mit saisonbereinigten Daten

Geld-, Kredit- und Finanzmärkte

- Empirische Analyse der geldpolitischen Transmission
- Ökonometrische Schätzung Agenten basierter Modelle (DFG-Projekt 2004-2007)
- Portfoliooptimierung unter unterschiedlichen Risikomaßen: Der Einfluss von Verteilungsannahmen

Heuristische Optimierung in Ökonometrie und Statistik

- Design von Experimenten (Uniform Design, Förderung durch DAAD 2003-2005)
- Automatisierte Modellauswahl in VAR- und VEC-Modellen
- Zensierte Quantilsregression
- COMISEF (Computational Optimization Methods in Statistics, Econometrics and Finance): Koordinator eines Marie Curie Research Training Network (EU-Projekt 2006-2010)
- Schätzung von GARCH-Modellen mit heuristischen Verfahren
- Schätzung von LSTAR-Modellen mit heuristischen Verfahren

Monte Carlo und Quasi-Monte Carlo Verfahren

- Simulation von (nichtlinearen) Zeitreihenmodellen
- Monte Carlo Methoden im Financial Engineering

Ökonometrische Analyse von Bildungsentscheidung und Bildungserfolg

- Geschwisterkonstellation und Bildungsentscheidung
- Familienstand der Eltern und Bildungsentscheidung

2. Kooperationen und Gäste

Gäste:

- Prof. Manfred Gilli, University of Geneva, 26.-29.10.2006: Teilnahme am Mini-Workshop "Portfolio-Optimierung"

Kooperationen:

- Prof. Thiess Büttner, ifo Institut und Ludwig-Maximilian-Universität München (seit 2005): Prognoseansätze für Steueraufkommen und Transferzahlungen
- Prof. John S. Chipman, University of Minnesota (seit 1993): Optimal Aggregation
- Prof. Horst Entorf, Universität Darmstadt (seit 1998): Criminometrics
- Prof. Kai-Tai Fang, Beijing Normal University-Hong Kong Baptist University United International College UIC (seit 1995): Uniform Design
- Prof. Bernd Fitzenberger, Universität Frankfurt (seit 1998): Censored Quantile Regressions
- Prof. Manfred Gilli, University of Geneva (seit 1999): Econometrics of Financial Markets, Applications of Optimization Heuristics in Econometrics
- Prof. Jenny Li, Pennsylvania State University (seit 1999): Quasi-Monte Carlo Simulations
- Prof. Werner Smolny, Universität Ulm, und ZEW Mannheim (seit 1997): Macroeconomic Modelling
- Prof. Aleksander Welfe, Universität Lodz (seit 2004): Vorbereitung eines gemeinsamen Forschungsvorhabens zur Modellierung von Strukturbrüchen
- Dr. Andreas Worms, Deutsche Bundesbank, und Oliver Hülsewig, ifo Institut, München (seit 1999): Monetary Policy Transmission

3. Publikationen

Bücher

P. Winker (2006): "Empirische Wirtschaftsforschung und Ökonometrie", Springer, Heidelberg (2. Aufl.).

Referierte Fachzeitschriften

Tagungsbände

P. Winker (2006): "The stochastics of Threshold Accepting: Analysis of an application to the uniform design problem", in: Rizzi, A. and Vichi, M. (Hg.), "COMPSTAT 2006, Proceedings in Computational Statistics", Physica, Heidelberg, 495-503.

P. Winker und D. Maringer (2006): "The Threshold Accepting Optimization Algorithm in Economics and Statistics", in: Kontoghiorgos, E. and Gatu, C. (Hg.), "Advances in Computational Economics, Finance and Management Science", Kluwer, erscheint demnächst.

P. Winker und D. Maringer (2006): "The convergence of optimization based GARCH estimators: Theory and application", in: Rizzi, A. and Vichi, M. (Hg.), "COMPSTAT 2006, Proceedings in Computational Statistics", Physica, Heidelberg, 483-494.

Diskussionspapiere

T. Büttner, A. Dehne, G. Flaig, O. Hülsewig und **P. Winker** (2006): „Berechnung der BIP-Elastizitäten öffentlicher Ausgaben und Einnahmen zu Prognosezwecken und Diskussion ihrer Volatilität“, ifo Forschungsberichte 28, Institut für Wirtschaftsforschung an der Universität München.

M. Meyer und D. Maringer (2006): „Smooth Transition Autoregressive Models - New Approaches to the Model Selection Problem“, CCFEA Working Paper Series, WP010-06, University of Essex, Colchester.

P. Winker und **V. Jeleskovic** (2006): „The Unconditional Distribution of Exchange Rate Returns: Statistics, Robustness, Time Aggregation“, CCFEA Working Paper Series, WP008-06, University of Essex, Colchester.

P. Winker und D. Maringer (2006): „The Threshold Acceptance Optimization Heuristic in Economics and Statistics“, CCFEA Working Paper Series, WP009-06, University of Essex, Colchester.

4. Vorträge und Konferenzen

- Peter Winker gehörte zum Scientific Programm Comittee des Eighth Workshop of the ERCIM Working Group on Matrix Computations and Statistics, Salerno 2.-3.9.2006
- Peter Winker war Veranstalter der Mini-Workshops “Portfolio-Optimierung”, der am 27.10.2006 an der JLU stattfand mit Teilnehmern von der Universität Genf, der Universität Köln, der Fachhochschule Pforzheim und des Forschungszentrums St. Augustin von NEC.

Mitarbeiter	Konferenz/Forschungsseminar	Vortrag
Peter Winker	Verein für Socialpolitik Ausschuß für Ökonometrie Rauischholzhausen, März 2006	Die Konvergenz von auf heuristischer Optimierung basierenden Schätzern: Theoretischer Rahmen und Anwendung auf ein GARCH-Modell
Virginie Blaess	Deutsche Statistische Gesellschaft, Nachwuchsworkshop 2006, Berlin	Parents Marital Status and Children Educational Outcomes
Peter Winker	University of Essex, CCFEA, März 2006	Empirical validation of agent-based models of foreign exchange rates
Mark Meyer	Kopf-ball, Vorlesungsreihe zum Thema “Wissenschaft und Fußball“, Universität Bielefeld, 4.5.2006	Wie effektiv sind kurzfristige Trainerwechsel? Die Bundesliga im statistischen Rückblick
Vahidin Jeleskovic	FindEcon’2006, University of Lodz, Polen, 13.5.2006	Robustness of Multifractal Properties: An Empirical Assessment for Foreign Exchange Rates
Peter Winker	Statistikolloquium der Universitäten Marburg und Gießen, Marburg, 17.5.2006	Uniform Design: Theorie und Methoden
Mark Meyer	EconPsyFootball06 - The University of Mannheim workshop on Economics and Psychology of Football, Mannheim 3.6.2006	The Interplay of Organizational Demography and institutional change: The Example of the Defense Chain in German Football
Mark Meyer	Brown-Bag-Seminar der JLU Gießen, 26.6.2006	Eine Dekade Bundesliga-Fußball im statistischen Rückblick
Peter Winker	COMPSTAT 2006, Universität La Sapienza, Rom, 30.8.2006	The stochastics of Threshold Accepting: Analysis of an application to the uniform design problem
Mark Meyer	Udine workshop on "Nonlinear Dynamical Methods and Time Series Analysis“, Udine, 1.9.2006	STAR Models - New Approaches to the Model Selection Problem
Peter Winker	ERCIM Workshop, Universität Salerno, 2.9.2006	Optimal Lag Structure Selection in VEC-Models
Peter Winker	Seminar on Computational Economics and Finance, Universität Neuchatel, 24.11.2006	Heuristic Optimization in Econometric Modelling- ModelSelection using the Threshold Accepting Algorithm

5. Sonstiges

seit Dez. 2002 ist Peter Winker Associate Editor von “Computational Statistics and Data Analysis”

seit Jan. 2005 ist Peter Winker Mitherausgeber der “Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik”

seit Jan. 2006 ist Peter Winker Mitglied in der Gutachterkommission des DAAD (ProCope)