

 Inhalt archiviert am 2024-05-27



Advanced Spectral Techniques in Econometric Modelling of Macro-Financial Linkages in the Euro area

Ergebnisse in Kürze

Neuartige ökonometrische Modelle für den Umgang mit Finanzkrisen

Mit Europas Schuldenkrise wurde die Notwendigkeit für größere Anstrengungen bei der Überwachung der Wirtschaftslage und bei Prognosen der Marktentwicklung deutlich. Eine EU-Initiative entwickelte Werkzeuge, um bei der Identifizierung, Vorhersage und Regulierung der europäischen Finanzmärkte und Volkswirtschaften zu helfen.



© Thinkstock

Für die Vorhersage künftiger Entwicklungen in der Wirtschaft bieten Modelle, die auf Methoden wie der Multiskalen-Spektralanalyse (MSA) basieren, viel Potenzial. In diesem Sinne entwickelte das EU-finanzierte Projekt ASPECT (Advanced spectral techniques in econometric modelling of macro-financial linkages in the euro area) neue Vorhersagemodelle, um makroökonomische und finanztechnische Probleme der Eurozone zu beleuchten.

Die Projektpartner nutzten einige der neusten ökonometrischen Methoden für die

Identifizierung der vielseitigen Dynamik der globalen Märkte, vor allem aber der Euro-Zone. Die Ergebnisse wurden verwendet, um die Wirkung von lang- und kurzfristigen Krisen der europäischen und der globalen Wirtschaft zu untersuchen. Darüber hinaus wurde die wahrscheinliche Marktentwicklung auch mithilfe von MSA und Modellen zum dynamischen stochastischen allgemeinen Gleichgewicht (DSGE), einem anderen Prognosemodell, betrachtet.

Das Team maß die nationale und globale gegenseitige Abhängigkeit bei Konjunkturschwankungen, die eine Volkswirtschaft zwischen Phasen des Wachstums oder der Rezession in der Eurozone durchläuft. Es entwickelte auch neue DSGE- und zeitlich veränderliche ökonometrische Modelle und beurteilte die Vorhersagbarkeit von DSGE-Modellen im Vergleich mit etablierten statistischen Werkzeugen, die bis heute im Einsatz sind.

Um Wirtschafts- und Finanzmarktprognosen zu machen, entwickelte ASPECT neuartige Multiskalen-Dekompositionsverfahren. Es schuf auch einen nicht-linearen Kausalitätsprüfungsansatz mit spektraler Zeitskala und untersuchte die Ansteckungs-, Entkopplungs- und Spillover-Effekte der amerikanischen Finanzkrise auf den Euroraum, Asien, Brasilien, China, Indien, Russland und Südafrika.

Die Forscher lieferten neue Erkenntnisse über die Asset-Vorhersagbarkeit und das heterogene Verhalten auf den Finanzmärkten. In dem Bemühen, Ineffizienz und Marktvolatilität zu erklären, untersuchten sie, wie Informationen in den globalen Märkten verbreitet werden. Die Partner zeigten auch, dass Marktabhängigkeiten der Schlüssel zu einer optimalen Asset-Allokation und Portfoliodiversifikation sein könnten.

ASPECT nutzte das Gebiet der Wirtschaft, um innovative Modellierungsmethoden vorzuschlagen. Auf diese Weise wird es neue Möglichkeiten für die Politikgestaltung und das Krisenmanagement in der Zeit nach der Finanzkrise liefern.

Schlüsselbegriffe

ökonometrische Modelle, Finanzkrisen, Multiskalen-Spektralanalyse, Euroraum, Vorhersagemodell

Entdecken Sie Artikel in demselben Anwendungsbereich



„Spott“ aber kein Hohn im Bereich der Vermarktung interaktiver Inhalte



Informations- und Medizintechnologie in Kombination mit KI verbessert die Sichtung der Massen



Revolutionäres Werkzeug zur digitalen Verwaltung wichtiger Öl- und Energieanlagen



Verfahren und Instrumente zur angemesseneren Bewertung verletzlicher Stellen und zum Schutz von Unternehmensvermögenswerten vor Cyberangriffen



Projektinformationen

ASpecT

Finanziert unter

ID Finanzhilfvereinbarung: 303854

Projekt abgeschlossen

Startdatum

1 April 2012

Enddatum

31 März 2015

Specific programme "People" implementing the Seventh Framework Programme of the European Community for research, technological development and demonstration activities (2007 to 2013)

Gesamtkosten

€ 75 000,00

EU-Beitrag

€ 75 000,00

Koordiniert durch

ATHENS UNIVERSITY OF
ECONOMICS AND BUSINESS -
RESEARCH CENTER

 Greece

Dieses Projekt findet Erwähnung in ...

MAGAZIN RESEARCH*EU



**Blurring the lines: man
meets machine**

Letzte Aktualisierung: 17 März 2016

Permalink: <https://cordis.europa.eu/article/id/175168-novel-econometric-models-to-manage-financial-crises/de>

European Union, 2025