

NEWSLETTER

Nr. 7

01.08.2005

ot

Humboldt-Universität zu Berlin
Sonderforschungsbereich 649
Spandauer Str. 1
10178 Berlin – Germany

Redaktion:

Geschäftsstelle des SFB 649

Fon: +49 30 2093 5708

Fax: +49 30 2093 5617

Mail: sfb@wiwi.hu-berlin.de

Büro: Raum 306

<http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de>



VORANKÜNDIGUNGEN

22.-24.06.2006 2. SFB-Klausurtagung in Motzen

REGELMÄßIGE FORSCHUNGSSEMINARE

Eine Seminarübersicht finden Sie ebenfalls unter:
<http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/seminars.jsp>

QUANTITATIVE FINANCE SEMINAR

Ort: Spandauer Str. 1, Raum 203
Zeit: Montags von 14:00 bis 16:00 Uhr

- 24.10.2005 **Vincenzo Esposito Vinzi** (Università degli Studi di Napoli "Federico II")
"The Classical and the Partial Least Squares Approach to Structural Equation Modelling"
Hinweis: Diese Veranstaltung findet von 14:00 bis 18:00 Uhr statt.
- 02.11.2005 **David Yermack** (Stern School of Business, New York University)
- 14.11.2005 **Shih-Feng Huang** (National Sun Yat-sen University, Taiwan)
"Pricing derivatives of credit risk"
- 12.12.2005 **Rodney Wolff** (Queensland University of Technology)
"Weather derivatives"
Hinweis: Diese Veranstaltung findet von 14:00 bis 18:00 Uhr statt.
- 09.01.2006 **Georg Gebhardt** (LMU München)

NACHRICHTEN

Ingolf Dittmann (TP A1) hielt auf dem vom 17.06. bis zum 18.06.2005 in Bern stattfindenden Accounting Research Workshop einen Vortrag zum Thema "Lower salaries and no options? On the optimal structure of executive pay". Am 20.06.2005 hielt Dr. Dittmann denselben Vortrag an der Erasmus School of Economics in Rotterdam.
Am 26.08.2005 wird Dr. Dittmann zum gleichen Thema im Rahmen der vom 24.08. bis zum 27.08.2005 in Moskau stattfindenden Jahreskonferenz der "European Finance Association" vortragen.

Wolfgang Härdle (TP B1) ist Mitglied des Workshop Program Committee des Workshops "Financial Data Mining" (ISDA '05 "International Conference on Intelligent Systems Design and Applications" vom 08.09. bis zum 10.09.2005 in Breslau). Prof. Härdle war vom 27.06. bis zum 03.07.2005 an der Universität Kuwait und hielt dort ein Seminar zum Thema "GHICA Value at Risk: GH Distributions and Independent Component Analysis". Am 08.07.2005 erschien im Berliner Tagesspiegel der Artikel "Mautkontrolle mit Lücken", in dem sich Prof. Härdle als Sachverständiger zu Thema Mautkontrolltests äußerte.

Ying Chen (TP B1) hielt am 04.07.2005 auf der Konferenz "Financial Engineering and Risk Management" in Shanghai einen Vortrag zum Thema "GHICA - Risk Analysis with GH Distributions and Independent Components".

Sigbert Klinke (TP B1) hielt am 05.07.2005 auf der "37. Arbeitstagung über Methoden und Werkzeuge der Informatik für die Statistik der Arbeitsgruppen Computational Statistics, Statistical Computing und der Arbeitsgruppe Klassifikation und Datenanalyse in den Biowissenschaften" in Günzburg einen Vortrag zum Thema "Yxilon - a Modular Open-Source Statistical Programming Language".

Harald Uhlig (TP C1) hielt sich am 04.07.2005 zu Forschungszwecken an der Deutschen Bundesbank auf.

Mirko Wiederholt (TP C1) stellte am 24.06.2005 auf dem "Annual Meeting der Society for Economic Dynamics" in Budapest, Ungarn, ein Papier mit dem Titel "Optimal Sticky Prices under Rational Inattention" vor. Das Papier ist eine gemeinsame Arbeit mit Prof. Bartosz Maćkowiak.

Wolfgang Reichmuth (TP C5) hat gemeinsam mit Sebastian Bauch und Lisa Schmidl in dem von Prof. Helmut Gründl betreuten Hochschulteam den "Postbank Finance Award 2004/2005" gewonnen. Das Thema des zum zweiten Mal ausgeschriebenen Hochschulwettbewerbs war "Private Altersvorsorge und Lebenszyklusstrategien: Ein neues Geschäftsfeld für Banken?".

Michael Burda (TP C7) hielt am 14.07.2005 einen Vortrag zum Thema „Blue Laws: Eine theoretische und empirische Untersuchung der Ladenschlussgesetze in den USA“ am Zentrum für Europäische Wirtschaftsforschung in Mannheim.

Nicole Walter (TP C7) arbeitet seit dem 01.07.2005 als wissenschaftliche Mitarbeiterin im Teilprojekt C7.

GÄSTE DES SFB

Eine Übersicht finden Sie ebenfalls unter:
<http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/guests.jsp>

01.07. – 30.08.2005

Dipl.-Vw. Tarek Hassan, Ph.D. Candidate

Department of Economics, Harvard University, USA

Hauptforschungsschwerpunkte: Political Economy of Development, Macroeconomic Theory

Büro: Ziegelstraße 13a, Raum 602

Telefon: (030) 2093 1466

04.07. – 31.08.2005

Professor Kiho Jeong, Ph.D.

School of Economics and Trade, Kyungpook National University, Daegu City, Südkorea

Hauptforschungsschwerpunkte: Discrete Choice Model (with Neural Network Model), Time Series Econometrics, and Input-Output Model

Büro: Ziegelstraße 13a, Raum 604

Telefon: (030) 2093 1470

11.07. - 07.08.2005

Yingcun Xia, Ph.D.

Department of Statistics, National University of Singapore, Republik Singapur

Hauptforschungsschwerpunkte: Semiparametrics, Nonlinear Time Series, Epidemiology

Büro: Mohrenstr. 39, Raum 208

Telefon: (030) 20372 481

01.08. – 12.08.2005

Zdeněk Hlávka, Ph.D.

Department of Probability and Mathematical Statistics, Charles University Prague, Tschechische Republik

Hauptforschungsschwerpunkte: SPD Estimation using Nonlinear Least Squares, Robust Sequential Methods, Multivariate Statistics

Büro: Ziegelstraße 13a, Raum 502

Telefon: (030) 2093 1457

12.08. – 22.08.2005

Dr. Rainer Schulz

University of Aberdeen, Business School, Scotland, UK

Hauptforschungsschwerpunkte: Empirical Models of Real Estate Valuation and Prices, Real Options, Time Series Models

Büro: Ziegelstraße 13a, Raum 502

Telefon: (030) 2093 1457

26.09.-25.10.2005

Keisuke Honda

Hauptforschungsschwerpunkte: Computational Statistics, Time Series Analysis

Büro: Ziegelstraße 13a, Raum 507

Telefon: (030) 2093 1469

NEUE DISCUSSION PAPER

Die Discussion Paper des SFB 649 finden Sie unter:

<http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/discussionPapers.jsp>

- 2005-036:** **Astrid Matthey**
"Getting Used to Risk: Reference Dependence and Risk Inclusion"
- 2005-037:** **Harald Uhlig and Almuth Scholl**
"New Evidence on the Puzzles. Results from Agnostic Identification on Monetary Policy and Exchange Rates"

PUBLIKATIONEN

- Härdle, W. and Uhlig, H. (2005),**
Ökonomisches Risiko, *Humboldt-Spektrum*, **2005(1)**, 18-23.
- Mönch, E. and Uhlig, H. (2005),**
Towards a Monthly Business Cycle Chronology for the Euro Area, *Journal of Business Cycle Measurement and Analysis*, **2(1)**, 43-69.
(SFB649-Discussion Paper 2005-023:
<http://141.20.100.9/papers/pdf/SFB649DP2005-023.pdf>)
- Uhlig, H. (2005),** What are the effects of monetary policy on output? Results from an agnostic identification procedure, *Journal of Monetary Economics*, **52(2)**, 381-419.
- Wang, Q. and Härdle, W. (2005),**
Empirical Likelihood-based Dimension Reduction Inference for Linear Error-in-Responses Models with Validation Study, *Science in China, Serie A*, **47(6)**, 921-939.

SFB - MITARBEITER

Henning Weber

An dieser Stelle möchte der Sonderforschungsbereiches 649 "Ökonomisches Risiko" Henning Weber aus dem Teilprojekt C3 "Makroökonomische Risiken, ihre Ursachen und ihre konjunkturpolitische Beherrschbarkeit" vorstellen. Henning Weber studierte Volkswirtschaftslehre an der Humboldt-Universität zu Berlin. Im Jahre 2003 absolvierte er ein Praktikum bei der Europäischen Zentralbank. Seit Mai 2005 ist Henning Weber wissenschaftlicher Mitarbeiter bei Herrn Juniorprofessor Bartosz Maćkowiak, Ph.D. Dabei gilt sein Forschungsinteresse der quantitativen Makroökonomie, im Besonderen dynamischen, stochastischen, allgemeinen Gleichgewichtsmodellen und Geldpolitik, sowie der Ökonometrie.

SPRUCH DER WOCHE

„Ich habe gelernt, dass der Mensch nur dann
auf einen anderen herabschauen darf,
wenn er ihm hilft, sich aufzurichten.“

Gabriel José García Márquez (*1928)

Wir möchten darauf hinweisen, dass die Newsletter auf der Homepage des SFB 649 veröffentlicht werden.

**Der SFB 649 – Newsletter erscheint zu Beginn eines jeden Monats.
Redaktionsschluss für den 8. Newsletter ist der 26. August 2005.**