

# NEWSLETTER

**Nr. 10**  
02.10.2006

# st

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

Redaktion:  
Geschäftsstelle des SFB 649  
Telefon: +49 30 2093 5708  
Fax: +49 30 2093 5617  
E-Mail: [sfb649@wiwi.hu-berlin.de](mailto:sfb649@wiwi.hu-berlin.de)

Büro: Raum 306

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



**VORANKÜNDIGUNGEN**

Weitergehende Informationen finden Sie unter:  
<http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/events.jsp>

09.-10.10.2006 Hermann Otto Hirschfeld Lecture 2006  
**Professor Stephen M. Stigler, Ph.D.**  
 (University of Chicago, Department of Statistics)

Topics:

The twentieth century saw an explosive growth in theory and methodology for the analysis of data. The roots of that growth can be seen in earlier work, and these lectures will outline some of the more important themes in that development. The emphasis will be upon statistics and social science. The topics to be covered are expected to include:

1. Quetelet and social statistics
2. Galton, Edgeworth, Pearson, and early multivariate analysis; aggregation paradoxes
3. Parametric inference, maximum likelihood, and R. A. Fisher
4. Contingency tables and cross-classification of counted data

Location: Humboldt-Universität zu Berlin  
 Senatssaal im Hauptgebäude  
 Unter den Linden 6  
 D-10117 Berlin

Schedule:

<u>09.10.2006</u>	<u>10.10.2006</u>
14:00 - 14:15 Official welcome	09:00 - 10:30 Lecture 3
14:15 - 15:45 Lecture 1	10:30 - 11:00 Break
15:45 - 16:15 Break	11:00 - 12:30 Lecture 4
16:15 - 17:45 Lecture 2	12:30 - 14:30 Lunch
	14:30 - 16:00 Lecture 5

Enrollment:

To participate, please detach the reservation part of the leaflet (<http://www.case.hu-berlin.de/HOHL2006/HOHL2006.pdf>) and send it to us by fax. Participation is free thanks to sponsoring by the Society for Economics and Management at Humboldt University Berlin.

## NACHRICHTEN

**Astrid Matthey (TP A6)** nahm an der Jahrestagung 2006 des Vereins für Socialpolitik in Bayreuth teil und hielt am 27.09.2006 einen Vortrag zum Thema "Getting Used to the Future - Reference Dependence and Anticipatory Utility".

**Taleb Ahmad (TP B1)** nahm vom 28.08. bis zum 01.09.2006 an der "Compstat 2006" an der Universität La Sapienza in Rom teil und sprach dort am 30.08.2006 in der Session "Statistical Education and Web Based Teaching" zum Thema "On the difficulty to design Arabic e-learning system in statistics" (Zusammenarbeit mit Julius Mungo).

**Michal Benko (TP B1)** nahm am 28.09. und 29.09.2006 an der Konferenz "Financial System Modernisation and Economic Growth in Europe" der Deutschen Bundesbank und der Europäischen Zentralbank in Berlin teil.

**Enzo Giacomini (TP B1)** nahm an der vom 24.08. bis 28.08.2006 abgehaltenen Konferenz "21st Annual Congress of the European Economic Association & 61st European Meeting of the Econometric Society" (EEA-ESEM 2006) in Wien teil und hielt dort am 27.08. einen Vortrag mit dem Titel "Inhomogeneous Dependence Modelling with Time Varying Copulae".

**Wolfgang Härdle (TP B1)** nahm an dem im Rahmen des TransCoop-Projektes "Climate Risk, Securitization, and the Microstructure of Insurance Markets" vom 31.08. bis 02.09.06 stattfindenden "Workshop on Securitization of Weather and Climate Risk" teil und hielt dort am 01.09. einen Vortrag zum Thema "Convenience Yields for CO2 Emission Allowance Future Contracts".

Prof. Härdle ist Mitglied des Internationalen Programmkomitees der "3. IASTED International Conference on Financial Engineering and Applications (FEA 2006)", die vom 09.10. bis zum 11.10.06 an der Sloan School of Management am MIT in Cambridge, USA, stattfinden wird.

**Sigbert Klinke (TP B1)** hielt auf der "Statistischen Woche 2006" in Dresden am 20.09.2006 einen Vortrag mit dem Titel "Web-basierte Tools für den Einsatz in der Lehre" (Zusammenarbeit mit Bernd Rönz, Sibylle Schmerbach und Olga Zlatkin-Troitschanskaia).

**Uwe Ziegenhagen (TP B1)** nahm an der vom 28.08. bis 01.09.2006 in Rom abgehaltenen "Compstat 2006" teil und sprach dort am 29.08.2006 in der Session "Web Based Teaching" zum Thema "e-Learning Statistics - A Selective Review" (Zusammenarbeit mit Wolfgang Härdle und Sigbert Klinke).

**Lutz Hildebrandt** und **Dirk Temme (TP B2)** gaben vom 28.09. bis zum 30.09.2006 am Zentrum für Empirische Wirtschafts- und Sozialforschung der Universität zu Köln einen Workshop zum Thema "Structural Equation Modeling".

Das Institut für Marketing von Prof. Hildebrandt richtete zuvor vom 21.09. bis zum 23.09.2006 die Jahrestagung der Forschungsgruppe "Konsum und Verhalten" im brandenburgischen Netzeband aus. **Yasemin Boztug (TP B2)** hielt dort einen Vortrag zum Thema "Die Modellierung von Verbundkäufen für Konsumgüter des täglichen Bedarfs".

Nachdem **Prof. Joan Walker, Ph.D. (MIT)** Anfang Juli 2006 im Quantitative Finance Seminar ihre Forschungsmethoden und aktuellen Forschungsergebnisse zum Thema "Extended Discrete Choice Models" vorstellte und einen Vortrag zum Thema "Taking Attitudes Seriously: A Multi-context Approach to Behavioral Modeling" hielt, wurde die wissenschaftliche Zusammenarbeit mit dem Teilprojekt B2 intensiviert, um gemeinsame Forschungsprojekte zu verfolgen.

**Vladimir Spokoiny (TP B5)** befand sich vom 28.08. bis zum 22.09.2006 zu Forschungszwecken am Centre de Mathématique et Informatique der Université de Provence in Marseille, Frankreich, auf.

**Peter Imkeller (TP B6)** hielt am CIRM Marseille-Luminy, Frankreich, im Rahmen der vom 18.09. bis zum 22.09.2006 abgehaltenen "Journées de Probabilités" am 19.09. einen Vortrag zu dem Thema "Un modèle simple de traitement de risque exogène et une nouvelle notion de solutions d'équations différentielles stochastiques rétrogrades".

**Stefan Ried (TP C1)** trug am 29.09.2006 auf der Jahrestagung 2006 des Vereins für Socialpolitik unter dem Titel "A New Keynesian Open Economy Model versus the Six Major Puzzles in International Macroeconomics" vor.

**Christian Stoltenberg (TP C1)** war am 27.09.2006 auf der Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik Vorsitzender der Session A3 "Geldpolitik I", in der er ebenfalls einen Vortrag zum Thema "The Inactiveness of Central Banks: An Issue of Optimality?" (Zusammenarbeit mit Matthias Paustian) hielt.

**Mathias Trabandt (TP C1)** trug am 05.09.2006 das Papier "How Far Are We From The Slippery Slope? The Laffer Curve Revisited" (Zusammenarbeit mit Harald Uhlig) im Seminar bei der Europäischen Kommission in Brüssel vor. Zudem hielt er am 27.09.2006 auf der Tagung des Vereins für Socialpolitik in Bayreuth einen Vortrag zum Thema "Optimal Pre-Announced Tax Reforms Under Valuable And Productive Government Spending".

**Harald Uhlig (TP C1)** hielt sich zu Forschungszwecken vom 18.09. bis zum 20.09.2006 bei der Europäischen Zentralbank

in Frankfurt auf und im Anschluss daran vom 21.09. bis zum 22.09.2006 bei der Deutschen Bundesbank. Vom 26.09. bis zum 29.09.2006 nahm Prof. Uhlig an der Jahrestagung 2006 des Vereins für Socialpolitik in Bayreuth teil und war Panelredner des Panels 4: "Produktivität, Investitionen und Güter - Märkte in Ostdeutschland".

**Ralf Brüggemann (TP C2)** sprach am 27.09.2006 auf der Tagung des Vereins für Socialpolitik zum Thema "Finite Sample Properties of Impulse Response Intervals in SVECMs with Long-Run Identifying Restrictions".

**Carsten Trenkler (TP C2)** hielt am 28.08.2006 auf der EEA-ESEM 2006 einen Vortrag mit dem Titel "Boostrapping systems cointegration tests with a prior adjustment for deterministic terms". Am 29.09.2006 trug Dr. Trenkler auf der Tagung des Vereins für Socialpolitik zum Thema "Boostrapping Systems Cointegration Tests With a Prior Adjustment of Deterministic Terms" vor.

**Markus Fischer (TP C4)** nahm vom 14.09. bis zum 16.09.2006 am Convegno P.R.I.N. "Metodi Stocastici in Finanza Matematica" an der Universität von Lecce, Italien, teil und hielt im Rahmen der Konferenz einen Vortrag mit dem Titel "Time Discretisation and Rate of Convergence for the Optimal Control of Stochastic Systems with Delay" (Zusammenarbeit mit Giovanna Nappo).

**Andreas Thams (TP C6)** nahm vom 13.09. bis 15.09.2006 an der "38th Annual Conference" der Money, Macro and Finance Research Group an der University of York teil und stellte dort sein Paper "Fiscal Policy Effects in the European Union" vor.

**Michael Burda (TP C7)** war Mitorganisator des am 08.09. und 09.09.2006 abgehaltenen Forschungsworkshops "Advances in the Empirical Analysis of Retailing" am Wissenschaftszentrum in Berlin. Auf Einladung der Fundación Ramón Areces hielt sich Prof. Burda vom 12.09. bis zum 14.09.2006 in Madrid auf und hielt zwei öffentliche Vorträge zum Thema "The German Economy: Current Situation and Future Outlook" (Teil 1: "The German Economy at the Crossroads: Past Mistakes and Present Situation", Teil 2: "The Future of the German Economy: Complacency or Deeper Reforms"). Auf Einladung des Tinbergen Institutes in Amsterdam hielt Prof. Burda am 19.09.2006 einen Vortrag zum Thema "Blue Laws" im dortigen Forschungsseminar.

Die Urania Berlin e.V. lud Prof. Burda am 20.09.2006 zu einem Expertengespräch zum Thema des neuen Buches von Prof. Max Otte "Der Crash kommt – Die neue Weltwirtschaftskrise und wie Sie sich darauf vorbereiten" ein. Weitere Teilnehmer waren Prof. Hamer (Mittelstandsinstitut Niedersachsen) und Prof. Walter (Deutsche Bank). Das Expertengespräch fand als

öffentliche Veranstaltung im Haus der Urania statt und wurde für RBB-Inforadio von Frau Holzhey moderiert, aufgezeichnet und in gekürzter Form gesendet.

Als Mitglied des EALE Executive Board nahm Prof. Burda vom 21.09. bis zum 24.09.2006 an der Jahrestagung der European Association of Labour Economists in Prag teil. Er hielt einen Vortrag zum Thema "Blue Laws" und war Chairperson der Session "Labour Demand and Employment 3: Institutions". Vom 26.09. bis zum 29.09.2006 nahm Prof. Burda ebenfalls an der Jahrestagung 2006 des Vereins für Socialpolitik in Bayreuth teil und war Panelredner des Panels 4: "Produktivität, Investitionen und Güter - Märkte in Ostdeutschland".

**Michael Kvasnicka (TP C7)** stellte am 27.08.2006 auf der EEA-ESEM 2006 das in Zusammenarbeit mit Dr. Dirk Bethmann verfasste Paper "Boostrapping systems cointegration tests with a prior adjustment for deterministic terms" (SFB 649 Discussion Paper 2005-046) vor.

## NEUES VOM FEDC

Die Datenbank **SDC Platinum M&A** steht nun allen Mitarbeitern zur Verfügung. Diese Datenbank von Thomson Financial beinhaltet umfangreiche Informationen zu weltweiten Akquisitionen, Allianzen und Transaktionen. Ebenfalls von Thomson Financial ist die **Worldscope** Datenbank erworben worden und steht zur Verfügung. Die Datenbank beinhaltet detaillierte Informationen zu über 40.000 öffentlich gehandelten Unternehmen. Zudem wurde die Datenbank **Option Metrics Ivy** aktualisiert. Weiterführende Informationen bezüglich Inhalt und Nutzung der Datenbanken erhalten Sie wie gewohnt über das Webinterface oder die Mitarbeiter des FEDC.

## GÄSTE DES SFB

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

### Folgende Gastwissenschaftler forschen momentan am SFB 649:

Bis 08.10.2006

**Dr. Marcus Wagner**

(Technische Universität München, Dr. Theo Schöller-Stiftungslehrstuhl für Technologie- und Innovationsmanagement)

Projekt: Performance Effects of Innovation Strategies in the Semiconductor Industry

E-Mail: wagner [at] wi.tum.de

Ziegelstr. 13a, R. 601, Tel.: 2093-1462



## NEUE DISCUSSION PAPER

Die Discussion Paper des SFB 649 finden Sie unter:  
[http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/discussionPapers\\_de.php](http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/discussionPapers_de.php)

- 2006-066      **Lans Bovenberg and Harald Uhlig**  
"Pension Systems and the Allocation of Macroeconomic Risk"
- 2006-067      **Carsten Trenkler, Pentti Saikkonen and  
Helmut Lütkepohl**  
"Testing for the Cointegrating Rank of a VAR Process with  
Level Shift and Trend Break"
- 2006-068      **Pavel V. Gapeev**  
"Integral Options in Models with Jumps"
- 2006-069      **Zdeněk Hlávka and Michal Pešta**  
"Constrained General Regression in Pseudo-Sobolev Spaces  
with Application to Option Pricing"
- 2006-070      **R. Anton Braun and Harald Uhlig**  
"The Welfare Enhancing Effects of a Selfish Government in the  
Presence of Uninsurable, Idiosyncratic Risk"

## PUBLIKATIONEN

Die Publikationen des SFB 649 finden Sie unter:  
[http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/publications\\_de.php](http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/publications_de.php)

- Boztug, Y. und Silberhorn, N. (2006),**  
Modellierungsansätze in der Warenkorbanalyse im Überblick,  
*Journal für Betriebswirtschaft*, 56(2), 105-128.

## SFB - MITARBEITER

An dieser Stelle möchte der Sonderforschungsbereiches 649 "Ökonomisches Risiko" Astrid Matthey und Julia Schmid aus dem Teilprojekt A6 "Strategisches Risiko in experimentellen Spielen" von Prof. Dr. Dorothea Kübler vorstellen.



Astrid Matthey, TP A6

Astrid Matthey studierte Betriebswirtschaftslehre und verfasste ihre Diplomarbeit im Jahre 2001 zum Thema "Transformation und Entwicklung St. Petersburgs". Im Rahmen des Transform-Projektes "GloRos" arbeitete sie von Juni 2002 bis Juni 2003 an der Higher School of Economics in Moskau. Seit Januar 2005 ist Frau Matthey wissenschaftliche Mitarbeiterin am Institut für Mikroökonomie an der Technischen Universität Berlin und gleichzeitig beim SFB 649. Im Herbst 2005 befand sich Frau Matthey auf einem Forschungsaufenthalt an der University of California in Berkeley. Ihre Forschungsschwerpunkte sind Behavioral Economics, Risikoverhalten und Mikroökonomie.

Julia Schmid studierte Volkswirtschaftslehre an der Humboldt-Universität zu Berlin. Während des Studiums verbrachte sie ein Auslandssemester an der University of Western Ontario in Kanada. Ihre von Prof. Demougin betreute Diplomarbeit zum Thema "Arztinduzierte Nachfrage – Theorie und Analyse im deutschen Kontext" gab sie im November 2003 ab. Seit Juni 2004 ist Frau Schmid wissenschaftliche Mitarbeiterin bei Frau Prof. Dr. Kübler und seit Januar 2005 ebenfalls Mitarbeiterin des SFB 649. Ihre Forschungsschwerpunkte sind Behavioral und Experimental Economics.



Julia Schmid, TP A6

## SPRUCH DES MONATS

Leben ist Veränderung – wer sich nicht verändert,  
wird auch verlieren, was er bewahren möchte.

Gustav Heinemann  
(1899-1976)

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 11. Newsletter 2006 ist der 31. Oktober 2006.**