

# NEWSLETTER

**Nr. 3**

05.03.2007

# ot

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>

09.03.2007

### "KMU Infokompetenz"

Fortbildungsveranstaltung

weitere Informationen unter:

[http://www.ib.hu-](http://www.ib.hu-berlin.de/infokomp/ankuendung_praesenzlehrgang.html)

[berlin.de/infokomp/ankuendung\\_praesenzlehrgang.html](http://www.ib.hu-berlin.de/infokomp/ankuendung_praesenzlehrgang.html)

## VERANSTALTUNGSRÜCKBLICK

### 08.-11.03.2007 "Haindorf (Hejnice) Seminar 2007"

Vom 08.-11.03.2007 fand das diesjährige Haindorf Seminar der Teilprojekte B1 und B5 in der Tschechischen Republik statt. An dem Seminar nahmen ca. 30 Wissenschaftler aus China, Deutschland, Polen und der Tschechischen Republik teil. Während des ersten Tages hielten Wolfgang Härdle (TP B1) und Vladimir Spokoiny (TP B5) Vorträge zum Thema "Foundations and Applications of Modern Nonparametric Statistics". Während des zweiten Tages stellten die Doktoranden der beiden Teilprojekte den Stand ihrer Forschungsarbeiten vor.

## NACHRICHTEN

**Wolfgang Härdle (TP B1)** nimmt an einem Forschungsprogramm zum Thema "Non-linear and Complex Systems Analysis" am neu gegründeten National Centre for Economic Research (NCER) der Queensland University of Technology und der University of Technology, Sydney teil. Eine Übersicht über die Mitglieder der Forschungsgruppe gibt es unter:

<http://www.ncer.edu.au/programs/>

Wolfgang Härdle hielt am 01.02.2007 einen Vortrag an der Rheinischen Friedrich Wilhelms Universität Bonn über "Empirical Pricing Kernels and Investors Preferences".

Am 14.02.2007 hielt Wolfgang Härdle an der Columbia University in New York Vorträge zu den Themen "Measuring Risk: Extremes, Copulae and Tail Dependence", "Copulae in Tempore Variantes" und "Empirical Pricing Kernels and Investors Attitudes".

Am 15.02.2007 trug er am Courant Institute der NYU zum Thema "GHICA - VaR with GH distributions and ICA" vor.

Am 22.02.2007 sprach Wolfgang Härdle vor dem Ausschuss für Ökonometrie des Vereins für Socialpolitik in Schloss Rauischholzhausen zum Thema "Copulae in Tempore Variantes".

**Sigbert Klinke (TP B1)** hielt am 01.02.2007 an der Universität Göttingen einen Vortrag zum Thema "Web-basierte Tools für den Einsatz in der Lehre".

**Nadja Silberhorn (TP B2)** nahm am 22.02.2007 am 11. GEM Markendialog "Auf welchen Wegen mit Marken wachsen?" in Frankfurt am Main teil.

**Pavel Gapeev (TP B5)** hielt am 22.02.2007 einen Vortrag zum Thema "Pricing Perpetual Options in Jump-diffusion Models" an der Universität Dortmund.

**Harald Uhlig (TP C1)** hielt am 02.02.2007 an der Université Libre de Bruxelles, ECARES, Vorträge zu den Themen "Macroeconomics and Asset Markets: Some Mutual Implications" und "Explaining Asset Prices with External Habits and Wage Rigidities in a DSGE Model". Zu denselben Themen hielt er am 20.02.2007 einen Vortrag an der LSE in London. Am 21.02.2007 hielt er einen Vortrag zum Thema "Regional Labour Markets, Network Externalities and Migration: The Case of German Reunification" an der Brunel University in London. Am 27.02.2007 hielt Harald Uhlig einen Vortrag an der Universität Mannheim.

**Martin Uebele (TP C5)** hielt am 15.02.2007 beim "Graduate Workshop in Economic and Social History" am Nuffield College der University of Oxford einen Vortrag über "New Ways to Find the (Historical) Business Cycle: Spectral Analysis and Dynamic Factor Models".

**Michael C. Burda (TP C7)** hielt am 01.02.2007 bei der Auftaktveranstaltung des Seminars "Wein & Wissen" an der Wirtschaftswissenschaftlichen Fakultät der Humboldt-Universität zu Berlin einen Vortrag zum Thema "Zeitverwendung in der EU und in den USA: Neue Erkenntnisse".

Vom 08.-10.2.2007 nahm Michael C. Burda als Koreferent an der Sitzung des Ausschusses für Bevölkerungsökonomie des Vereins für Socialpolitik in Freinsheim teil.

Am 14.02.2007 hielt er im "Research Seminar in Economics" der FU Berlin einen Vortrag zum Thema "The Distribution of Total Work in the EU and the US".

Am 15.02.2007 nahm Michael C. Burda am sechsten Berliner Kolloquium zur Transnationalität am WZB teil. Die gemeinsame Veranstaltung der Irmgard Coninx Stiftung, des Wissenschaftszentrums Berlin für Sozialforschung und der Humboldt-Universität zu Berlin stand unter dem Motto "Population Politics and Human Rights".

Vom 22.-24.02.2007 nahm Prof. Burda an der Sitzung des Ausschusses für Ökonometrie des Vereins für Socialpolitik in Rauschholzhausen teil und hielt einen Vortrag zum Thema "The Distribution of Total Work in the EU and US".

Vom 19.02.-13.04.2007 hält sich Prof. Burda zu einem Forschungsaufenthalt als Wim Duisenberg Research Fellow an der Europäischen Zentralbank in Frankfurt am Main auf.

## NEUES VOM FEDC

Die Datenbank CRSP Stock & Indices wurde durch das FEDC erneuert. Ebenfalls wurden die Daten der Eurex-Datenbank aktualisiert. Das Update der Software Gauss auf die Version 8 wurde auf den Servern durchgeführt und steht nun zur Verfügung. Eine neue Version der Toolbox Partial Differential Equation für MATLAB 7.3 wurde auf den Servern installiert.

## 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:**

05.03.-  
30.04.2007

**Wolodimir Perederij**

Europa-Universität Viadrina Frankfurt (Oder)  
Forschungsgebiet: Quantitative Bilanzanalyse,  
insb. im Rahmen der Insolvenzprognose, insb.  
mittels multivariater Modelle  
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)

- 2007-005**      **Jürgen Franke, Jean-Pierre Stockis, Joseph Tadjuidje**  
"Quantile Sieve Estimates for Time Series"
- 2007-006**      **Monique Ebell, Albrecht Ritschl**  
"Real Origins of the Great Depression: Monopolistic  
Competition, Union Power, and the American Business Cycle in  
the 1920s"
- 2007-007**      **Oliver Volckart**  
"Rules, Discretion or Reputation? Monetary Policies and the  
Efficiency of Financial Markets in Germany, 14th to 16th  
Centuries"
- 2007-008**      **Ronald Bachmann, Michael C. Burda**  
"Sectoral Transformation, Turbulence, and Labour Market  
Dynamics in Germany"
- 2007-009**      **Thorsten Vogel**  
"Union Wage Compression in a Right-to-Manage Model"

2007-010

**Volker Krätschmer**

"On  $\sigma$ -additive robust representation of convex risk measures for unbounded financial positions in the presence of uncertainty about the market model"

## PUBLIKATIONEN

**Demougin, D., Fabel, O. (2007),**

The Division of Ownership in New Ventures, *Journal of Economics & Management Strategy*, 16(1), S. 111-128.

## SFB - MITARBEITER

An dieser Stelle möchte der Sonderforschungsbereich 649 "Ökonomisches Risiko" Herrn Pavel Gapeev aus dem Teilprojekt B5 "Strukturadaptive Datenanalyse" von Prof. Dr. Vladimir Spokoiny vorstellen.



Pavel Gapeev (TP B5)

Pavel Gapeev studierte von 1993 bis 1998 Mathematik an der Moskauer Lomonossov-Universität. Seine Diplomarbeit verfasste er zum Thema "On the Proof of the Fundamental Theorem of Asset Pricing". Anschließend promovierte er an der gleichen Universität über das Thema "Bayesian and Variational Problems of Sequential Analysis". Von 2001 bis 2006 hielt er sich als Stipendiat der Studienstiftung des Abgeordnetenhauses von Berlin zum Studien- und Forschungsaufenthalt an der Humboldt-Universität zu Berlin auf. Gleichzeitig arbeitete er seit 2002 als Wissenschaftler am Institut für Steuerungstheorie der Russischen Akademie der Wissenschaften.

Seit August 2006 ist Pavel Gapeev Mitarbeiter am Teilprojekt B5. Seine Forschungsinteressen liegen im Gebiet der stochastischen Analysis und seiner Anwendung in der Finanzmathematik, sowie in Gebieten der optimalen stochastischen Steuerung (darunter Theorie des optimalen Stoppens) und der Statistik stochastischer Prozesse. Er arbeitet derzeit an der Anwendung des optimalen Stoppens in der stochastischen Analysis, in der mathematischen Statistik und in der Finanzmathematik. Daneben interessiert er sich für Modelle des Finanzmarktes mit Liquiditätsrisiko und Kreditrisiko unter unvollkommenen Informationen, sowie für robuste Absicherung in Gauß'schen Modellen. Neben seiner Forschungstätigkeit ist Pavel Gapeev als Referee und Reviewer für verschiedene mathematische Journale tätig.

### **SPRUCH DES MONATS**

"Lernen ist wie das Rudern gegen den Strom;  
sobald man aufhört, treibt man zurück. "

Laotse  
(6. Jh. v. Chr.)

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 4. Newsletter 2007 ist der 30. März 2007.**