

NEWSLETTER

Nr. 9

12.09.2007

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

Büro: Raum 306

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



VORANKÜNDIGUNGEN

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

- 06.-12.09.2007 **SFB 649 Junior Workshop for Ph.D. students
"Choosing and Processing Information in Economic
Models"**
Informationen unter:
<http://sfb649.wiwi.hu-berlin.de/fedc/events/juniorworkshop/>
- 09.-12.10.2007 **Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik**
Informationen unter:
<http://www.socialpolitik.org/vfs.php?mode=jahrestagung&lang=1>
- 27.-28.10.2007 **Humboldt-Princeton Konferenz**
Informationen unter:
<http://www.case.hu-berlin.de/events/events/HU-Princeton2007/>
- 29.-30.10.2007 **Hermann Otto Hirschfeld Lecture 2007**
Informationen unter:
<http://www.case.hu-berlin.de/events/events/HOHL2007/hohl2007.html>

NACHRICHTEN

Jenny Kragl (TP A4) und **Anja Schöttner (TP A4)** nahmen vom 27.08.-31.08.2007 an der Jahrestagung der European Economic Association 2007 in Budapest teil und präsentierten dort jeweils ein Paper. Jenny Kragl sprach über "Relational Contracts and Inequity Aversion" und Anja Schöttner hielt einen Vortrag über "Promotion Tournaments and Individual Performance Pay".

Lydia Mechtenberg (TP A6) hielt sich vom 13.-17.08.2007 zu Forschungszwecken am Max Planck Institute for Research on Collective Goods in Bonn auf.

Enzo Giacomini (TP B1) nahm am 20.08.2007 an der Konferenz "Advances in Semiparametric Methods and Applications" des CEMAPRE – Centre for Applied Mathematics and Economics an der Technical University of Lisbon und am 25.08.2007 an der "56th session of the International Statistical Institute" in Lissabon teil und hielt jeweils den Vortrag "Statistics of Risk Aversion".

Wolfgang Härdle (TP B1) nahm am 21.08.2007 an der Konferenz "Advances in Semiparametric Methods and Applications" des CEMAPRE – Centre for Applied Mathematics and Economics an der Technical University of Lisbon teil und hielt einen Vortrag zum Thema "Semiparametrics in quantitative finance". Vom 22.-29.08.2007 nahm er an der "56th session of the International Statistical Institute" in Lissabon teil und trug zu "Dynamic semiparametric factor models" vor.

Sigbert Klinke (TP B1) nahm vom 22.-29.08.2007 an der "56th Session of the International Statistical Institute" in Lissabon teil. Er beteiligte sich als Organisator, Chair und Diskutant an der Session "Invited Paper Meeting 36 - Statistical Algorithms and Software", welche am 29.08.2007 stattfand.

Stefan Ried (TP C1) nahm an der Jahrestagung der European Economic Association 2007 in Budapest teil und hielt dort am 31.08.2007 einen Vortrag zum Thema "How Do Heterogeneities Affect Welfare in a Monetary Union? A Game Theoretic Approach with Optimizing Monetary and Fiscal Policies".

Harald Uhlig (TB C1) nahm vom 27.-31.08.2007 an der Jahrestagung der European Economic Association 2007 in Budapest teil.

Martin Uebele (TP C5) hielt am 30.08.2007 anlässlich der Jahrestagung der European Economic Association 2007 in Budapest den Vortrag "The U.S. Business Cycle, 1866-1995: Dynamic Factor Analysis vs. Reconstructed National Accounts".

Michael C. Burda (TP C7) hielt sich zu Forschungszwecken vom 26.-29.08.2007 am Centre for Economic and Business Research (CEBR) in Kopenhagen und vom 29.08.-02.09.2007 an der Norwegian School of Economic and Business Administration in Bergen auf.

NEUES VOM FEDC






Die Eurex-Datenbank wurde aktualisiert, sodass nun die Daten bis August 2007 zur Verfügung stehen. Ebenfalls wurden die Datenbanken CRSP und Compustat Global sowie Compustat North America auf den neusten Stand gebracht.

Die Software Matlab konnte durch die Unterstützung von Harald Uhlig (TP C1) um die "Distributet Toolbox" erweitert werden, wodurch Matlab nun multiprozessorfähig ist. Zurzeit testet das FEDC noch die Möglichkeiten dieser Toolbox. Auf den FEDC-Servern steht nun auch die Software R zur Verfügung. Sie kann über die Benutzeroberfläche "jaguar" (JGR) sowie über die Konsole genutzt werden.

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:

- | | | |
|-----------------------|---|---|
| 06.-07.09.2007 | Andreas Röthig
TU Darmstadt
Forschungsgebiet: Empirical investigation of futures markets: Performance, interrelations and microstructure
Ziegelstr. 13a, R. 607, Tel.: 2093-1455 |  |
| 17.04.-
31.12.2007 | Carsten Trenkler
Universität Mannheim
Projekt: Einheitswurzel- und Kointegrationsmethodik
trenkler@uni-mannheim.de ,
Tel.: 0621-181-1852 |  |
| 15.04.-
30.09.2007 | Irina Lobuzova
State University - Higher School of Economics, Moscow
Projekt: Dynamic Modeling of Optimal Capital Structure |  |
| 15.04.-
30.09.2007 | Evgeny Borodkin
State University – Higher School of Economics, Moscow
Projekt: Estimation of sales-based betas for US and European companies |  |
| 24.09.-
05.10.2007 | Maik Schmeling
Leipnitz Universität Hannover
Projekt: Non-linear risk and the Cross-Section of Stock returns
Ziegelstr. 13a, R. 607, Tel.: 2093-1674 |  |

01.06.-
31.12.2007

Yarema Okhrin

European University Viadrina
Projekt: 1. Estimation risk and model uncertainty in asset allocation procedures
2. Modelling and analysing the dependency structures using hierarchical Archimedean copulae
Ziegelstr. 13a, R. 601, Tel.: 2093-1462



31.05.2007-
31.12.2008

Eduardo Ortiz Tanchez

University of Oxford
Projekt: Effekt der Wahl des Basiswertes auf den Preis von Wetterderivaten
Ziegelstr. 13a, R. 601, Tel.: 2093-1462



01.08.-
31.10.2007

Jens Schmidt-Ehmcke

Deutsches Institut für Wirtschaftsforschung (DIW Berlin)
Ziegelstr. 13a, R. 602, Tel.: 2093-1466



06.-16.09.2007

Oliver Vogler

Universität Regensburg
Projekt: Informationsrisiken im Zusammenhang mit der Bewertung von Unternehmensportfolios
mail [at] olivervogler.de



12.09.-
12.10.2007

Christoph Trebesch

Hertie School of Governance/Freie Universität Berlin
Projekt: On the Cost and Consequences of Sovereign Default
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

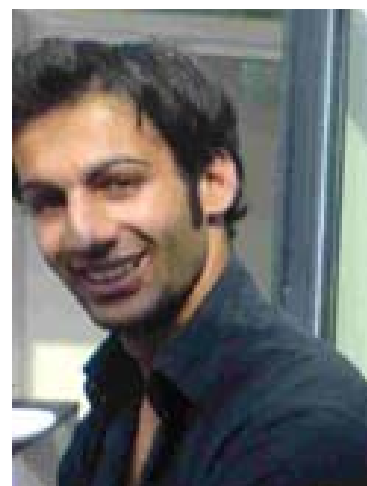
- 2007-050** **Wolfgang Härdle, Sigbert Klinke, Uwe Ziegenhagen**
 "On the Utility of E-Learning in Statistics"
- 2007-051** **Tseveen Gantumur, Andreas Stephan**
 "Mergers & Acquisitions and Innovation Performance in the Telecommunications Equipment Industry"
- 2007-052** **Nikolaus Hautsch**
 "Capturing Common Components in High-Frequency Financial Time Series: A Multivariate Stochastic Multiplicative Error Model"
- 2007-053** **Michael Kvasnicka, Dirk Bethmann**
 "World War II, Missing Men, and Out-of-wedlock Childbearing"
- 2007-054** **Carolin Decker, Thomas Mellewig**
 "The Drivers and Implications of Business Divestiture – An Application and Extension of Prior Findings"

SFB - MITARBEITER

An dieser Stelle möchte der Sonderforschungsbereich 649 "Ökonomisches Risiko" Herrn Pooyan Amir Ahmadi, Mitarbeiter im Projekt C3 "Internationale und makroökonomische Risiken, ihre Ursachen und ihre konjunkturpolitische Beherrschbarkeit" von Juniorprof. Bartosz Mackowiak, vorstellen.

Pooyan Amir Ahmadi studierte von 2000 bis 2006 Volkswirtschaftslehre an der Humboldt-Universität zu Berlin. Seine Diplomarbeit verfasste er zum Thema "Measuring the Effects of a Shock to Monetary Policy: A Bayesian Factor-Augmented Vector Autoregression Approach (BFAVAR) with Agnostic Identification". Seit November 2006 absolviert er ein Ph.D.-Studium und arbeitet als wissenschaftlicher Mitarbeiter im Teilprojekt C3. Seine Forschungsinteressen liegen vor allem im Bereich der Bayesianischen Zeitreihenökonomie sowie Dynamischer Faktormodelle, Geldtheorie und -politik, Great Depression und Makroökonomie allgemein.

Von April 2005 bis Oktober 2006 arbeitete Pooyan Amir Ahmadi als studentische Hilfskraft für Prof. Ritschl.



Pooyan Amir Ahmadi, TP C3

SPRUCH DES MONATS

"Zu neuen Ufern lockt ein neuer Tag."

Johann Wolfgang von Goethe
(1749-1832)

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 10. Newsletter 2007 ist der 28. September 2007.**