

**Institut für Statistik und Ökonometrie  
der Christian - Albrechts - Universität Kiel**

**Tätigkeitsbericht**

**2003 - 2006**

## Neustart

Die Jahre 2003 und folgende brachten für unser Institut gewaltige Veränderungen. Im März 2003 wurde Prof. Dr. Gerd Hansen, der seit 1979 den Lehrstuhl für Ökonometrie innehatte, emeritiert, und zum gleichen Zeitpunkt folgte Prof. Dr. Stefan Mittnik, der 10 Jahre den Lehrstuhl für Statistik und empirische Wirtschaftsforschung hatte, einem Ruf nach München. Sehr viele Mitarbeiter verließen zum gleichen Zeitpunkt unser Institut. Im September 2003 wurde dann PD Dr. Marc Paoella, der 9 Jahre am Lehrstuhl für Statistik und empirische Wirtschaftsforschung tätig war, Professor an der Universität Zürich. Und schließlich folgte auch PD Dr. Martin Missong nach 15 Jahren Arbeit an unserem Institut im April 2005 einem Ruf an die Universität Bremen.

Die Lehrstühle für Ökonometrie beziehungsweise Statistik und empirische Wirtschaftsforschung wurden schon im Oktober 2003 mit Prof. Dr. Helmut Herwartz und Prof. Dr. Roman Liesenfeld wieder neu besetzt, und auch die Mitarbeiterstellen blieben nicht lange vakant.

Eine letzte und sehr traurige Veränderung trat dann aber im Oktober 2004 durch den Tod von Prof. Dr. Dr. h.c. Wolfgang Wetzel ein, dem Inhaber des Lehrstuhls für Statistik von 1960 bis 1965 und von 1971 bis 1987 und Gründer unseres Instituts, der sich für unser Institut und unser Fach große Verdienste erworben hat und der bis zuletzt dem Institut sehr verbunden war.

Dieser Tätigkeitsbericht der Jahre 2003 bis 2006 soll in dieser Phase des Neustarts die Leistungen des Instituts für Statistik und Ökonometrie (ISÖ) in Forschung und Lehre aufzeigen.

# Inhaltsverzeichnis

<b>1</b>	<b>Organisation des Instituts</b>	<b>1</b>
<b>2</b>	<b>Forschung</b>	<b>2</b>
2.1	Publikationen . . . . .	2
2.1.1	Aufsätze in Fachzeitschriften . . . . .	2
2.1.2	Aufsätze in Sammelbänden . . . . .	4
2.1.3	Buch-Veröffentlichungen . . . . .	5
2.1.4	Diskussionspapiere . . . . .	5
2.1.5	Sonstiges . . . . .	7
2.1.6	Herausgeberschaft . . . . .	7
2.2	Von Institutsmitgliedern gehaltene Vorträge . . . . .	7
2.3	Forschungsaufenthalte . . . . .	10
2.4	Extern finanzierte Forschungsprojekte . . . . .	11
2.5	Aufenthalte von Gastwissenschaftlern . . . . .	11
2.6	Am Institut betreute wissenschaftliche Arbeiten . . . . .	11
2.6.1	Habilitationen . . . . .	11
2.6.2	Dissertationen . . . . .	12
2.6.3	Diplomarbeiten . . . . .	12
2.7	Laufende Dissertationsprojekte . . . . .	13
2.8	Statistisch-ökonomisches Seminar . . . . .	13
2.8.1	Wintersemester 2003/04 . . . . .	13
2.8.2	Sommersemester 2004 . . . . .	14
2.8.3	Wintersemester 2004/05 . . . . .	14
2.8.4	Sommersemester 2005 . . . . .	15
2.8.5	Wintersemester 2005/06 . . . . .	16
2.8.6	Sommersemester 2006 . . . . .	16
2.8.7	Wintersemester 2006/07 . . . . .	17
<b>3</b>	<b>Lehre</b>	<b>18</b>
3.1	Lehrveranstaltungen . . . . .	18
3.1.1	Sommersemester 2003 . . . . .	18
3.1.2	Wintersemester 2003/04 . . . . .	19
3.1.3	Sommersemester 2004 . . . . .	20
3.1.4	Wintersemester 2004/05 . . . . .	21
3.1.5	Sommersemester 2005 . . . . .	22
3.1.6	Wintersemester 2005/06 . . . . .	23
3.1.7	Sommersemester 2006 . . . . .	24
3.1.8	Wintersemester 2006/07 . . . . .	25

3.1.9	Sonstige Lehrveranstaltungen . . . . .	26
3.2	Auszeichnungen . . . . .	26
3.3	Externe Nutzung unseres PC-Labors . . . . .	27
<b>4</b>	<b>Weitere Aktivitäten</b>	<b>29</b>
4.1	Konferenzorganisation . . . . .	29
4.2	Gutachtertätigkeit . . . . .	29
4.2.1	Gutachten für Fachzeitschriften . . . . .	29
4.2.2	Sonstige Gutachten . . . . .	30
4.3	Mitgliedschaften . . . . .	30
4.4	Akademische Selbstverwaltung . . . . .	31
4.5	Populärwissenschaftliche Vorträge . . . . .	32
4.6	Interviews . . . . .	32

# 1 Organisation des Instituts

Das Team des Instituts bestand im Dezember 2006 aus:

## Professoren

Prof. Dr. Helmut Herwartz, Lehrstuhl für Ökonometrie

Prof. Dr. Roman Liesenfeld, Lehrstuhl für Statistik und Empirische Wirtschaftsforschung

## Emeritus

Prof. Dr. Gerd Hansen

## Juniorprofessor

Prof. Dr. Vasyl Golosnoy

## Kursbeauftragter Mathematik

PD Dr. Uwe Jensen

## Betreuer der Rechenanlage

Albrecht Mengel, Dipl.-Informatiker

## Wissenschaftliche Mitarbeiter

Christian Aßmann, Dipl.-Volksw.

Jens Hogrefe, Dipl.-Volksw.

Fang Xu, M.Sc.

Daniel Drescher, Dipl.-Kfm.

Florian Siedenburg, Dipl.-Volksw.

Guilherme Valle Moura, M.A.

## Sekretärinnen

Ilse Plaep (Ökonometrie)

Angelika Reinmüller (Statistik)

## Wissenschaftliche Hilfskräfte

Cetin-Behzet Cengiz    Stella Daskalova

Bastian Gribisch    Monika Hallermeier

Martina Helms    Adriana Nicolae

Markus Pape    Jan Roestel

Christoph Strumann    Noemi Székely

Christian Werner

## 2 Forschung

Die Forschung am Institut konzentriert sich auf die folgenden Gebiete der empirischen Wirtschaftsforschung. Eine detailliertere Darstellung enthält der **Forschungsbericht** des Instituts.

- Analyse von Risiken in Systemen spekulativer Preise (Multivariate Volatilitätsmodelle)
- Stichprobenwiederholungsverfahren unter allgemeinen Annahmen über die Störterme ökonometrischer Modelle
- Spezifikationstests und Inferenz bei Zeitreihen-Querschnittsdaten (Paneldaten)
- Modellierung und Prognose von Konjunkturzyklen
- Monte-Carlo-Simulationsmethoden für die statistische Inferenz
- Strukturelle Volatilitätsmodelle
- Statistische Prozesskontrolle
- Statistische Methoden in der Finanzwirtschaft
- Methodologische Grundlagen und Robustheit von Frontierfunktionen
- Mikroökonomische Modellierung von Einkommen und Arbeitszufriedenheit
- Ausbildungsinadäquanzmessung
- Genauigkeit von Hochschulranglisten
- Analyse ökonometrischer Nachfragesysteme
- Wohlfahrtsmessung und Wohlfahrtsvergleiche für private Haushalte

### 2.1 Publikationen

Im Berichtszeitraum wurden von den Institutsmitgliedern folgende Arbeiten veröffentlicht:

#### 2.1.1 Aufsätze in Fachzeitschriften

GOLOSNOY, V. [2006], “EWMA control charts for monitoring optimal portfolio weights” (mit W. Schmid), *Sequential Analysis*, erscheint demnächst.

GOLOSNOY, V. [2006], “Multivariate shrinkage for optimal portfolio weights” (mit Y. Okhrin), *European Journal of Finance*, erscheint demnächst.

- GOLOSNOY, V. [2006], “Sequential monitoring of minimum variance portfolio,” *Allgemeines Statistisches Archiv*, erscheint demnächst.
- HANSEN, G. [2004], “Inflationäre Schocks in Deutschland. Eine Common-Trends-Analyse” (mit K. Carstensen), *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik* 224/3, 271-291.
- HANSEN, G. [2005], “Macroeconometrics between theory and data analysis,” *Applied Economics Quarterly* 51/2, 111-120.
- HERWARTZ, H. [2003], “On the (nonlinear) relationship between exchange rate uncertainty and trade - An investigation of US trade figures in the Group of Seven,” *Weltwirtschaftliches Archiv* 139, 650-682.
- HERWARTZ, H. [2003], “Seasonal cointegration analysis for German M3 money demand” (mit H.E. Reimers), *Applied Financial Economics* 13, 71-78.
- HERWARTZ, H. [2003], “The determinants of health care expenditure: Testing pooling restrictions in small samples” (mit B. Theilen), *Health Economics* 12, 113-124.
- HERWARTZ, H. [2003], “Time inhomogeneous multiple volatility modeling” (mit W. Härdle, V.G. Spokoiny), *Journal of Financial Econometrics* 1, 55-95.
- HERWARTZ, H. [2004] “Bootstrap inference in single equation error correction models” (mit M.H. Neumann), *Journal of Econometrics* 128, 165-193.
- HERWARTZ, H. [2005], “Exchange rate uncertainty and trade growth – a comparison of linear and non-linear (forecasting) models” (mit H. Weber), *Applied Stochastic Models in Business and Industry* 21, 1-26.
- HERWARTZ, H. [2006], “A Lagrange multiplier test for causality in variance” (mit C.M. Hafner), *Economics Letters* 93, 137-141.
- HERWARTZ, H. [2006], “Econometric analysis of high frequency data,” *Allgemeines Statistisches Archiv* 90, 89-104.
- HERWARTZ, H. [2006], “Long run links among money, prices and output: worldwide evidence” (mit H.-E. Reimers), *German Economic Review* 7, 65-86.
- HERWARTZ, H. [2006], “Testing for random effects in panel data under cross-sectional error correlation – a bootstrap approach to the Breusch-Pagan test,” *Computational Statistics and Data Analysis* 50, 3567-3591.
- HERWARTZ, H. [2006], “Volatility impulse responses for multivariate GARCH models: An exchange rate illustration” (mit C.M. Hafner), *Journal of International Money and Finance* 25, 719-740.
- JENSEN, U. [2005], “Misspecification preferred: The sensitivity of inefficiency rankings,” *Journal of Productivity Analysis* 23, 223 - 244.
- JENSEN, U. [2006], “Stochastic production frontiers with multiply imputed German establishment data” (mit S. Rässler), *Zeitschrift für ArbeitsmarktForschung* 39/2, 277-295.
- LIESENFELD, R. [2003], “The estimation of dynamic bivariate mixture models: Comments on Watanabe (2000)” (mit J.-F. Richard), *Journal of Business & Economic Stati-*

*stics* 21, 570-576.

LIESENFELD, R. [2003], “Univariate and multivariate stochastic volatility models: Estimation and diagnostics” (mit J.-F. Richard), *Journal of Empirical Finance* 10, 505-531.

LIESENFELD, R. [2005], “A nonlinear forecasting model of GDP growth” (mit D.N. DeJong und J.-F. Richard), *The Review of Economics and Statistics* 87, 697-708.

LIESENFELD, R. [2006], “Classical and Bayesian analysis of univariate and multivariate stochastic volatility models” (mit J.-F. Richard), *Econometric Reviews* 25, 1-26.

LIESENFELD, R. [2006], “Modeling financial transaction price movements: a dynamic integer count data model” (mit I. Nolte und W. Pohlmeier), *Empirical Economics* 30, 795-825.

LIESENFELD, R. [2006], “Time series of count data: modeling, estimation and diagnostics” (mit R.C. Jung und M. Kukuk), *Computational Statistics & Data Analysis* 51, 2350 - 2364.

LIESENFELD, R. [2006], “Timing structural change: A conditional probabilistic approach” (mit D.N. DeJong und J.-F. Richard), *Journal of Applied Econometrics* 21, 175-190.

MISSONG, M. [2003], “Estimation of quadratic expenditure systems using german household budget data” (mit K. Kohn), *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik* 223, 422-448.

XU, F. [2005], “Does consumption-wealth ratio signal stock returns? – VECM results for Germany,” *Economics Bulletin* 3/30, 1-13.

### **2.1.2 Aufsätze in Sammelbänden**

HANSEN, G. [2004], “A brief review of macroeconometrics,” in: Dreger, C. und G. Hansen (Hrsg.), *Advances in macroeconomic modeling*, Papers and Proceedings of the 3rd IWH Workshop in Macroeconometrics, Schriften des Instituts für Wirtschaftsforschung Halle, Bd. 15.

HERWARTZ, H. [2006], “Conditional heteroskedasticity”, in: Lütkepohl, H. und M. Krätzig (Hrsg.), *Applied time series econometrics*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. [2006], “VaR in high dimensional systems – a conditional correlation approach” (mit B. Pedrinha), in: Härdle, W., T. Kleinow und G. Stahl (Hrsg.): *Applied Quantitative Finance*, Springer Verlag, erscheint demnächst.

HOGREFE, J. [2006], “Verteilungseffekte der Familienförderung”, in: Seidl, C. und J. Jickeli (Hrsg.), *Steuern und Soziale Sicherung in Deutschland*, Springer Verlag.

JENSEN, U. [2003], “Measuring overeducation with earnings frontiers and panel data,” in: Büchel, F., A. de Grip und A. Mertens (Hrsg.), *Overeducation in Europe: Current issues in theory and practice*, Edward Elgar, 155-169.

JENSEN, U. [2003], “Which feeling is stronger: Jealousy or laziness?” in: Klein, I. und S. Mittnik (Hrsg.), *Contributions to modern econometrics - from data analysis to economic*



*policy*, Kluwer, 105-118.

JENSEN, U. [2004]: “Multivariate statistics,” in: Teugels, J.L. und B. Sundt (Hrsg.), *Encyclopedia of Actuarial Science*, Bd. 2, Wiley, 1147-1152.

LIESENFELD, R. [2003], “Ein dynamisches Hürdenmodell für Transaktionspreisänderungen auf Finanzmärkten” (mit W. Pohlmeier), in: Franz, W., H.J. Ramser und M. Stadler (Hrsg.), *Empirische Wirtschaftsforschung: Methoden und Anwendungen*, Wirtschaftswissenschaftliches Seminar Ottobeuren, Band 32, Mohr Siebeck.

LIESENFELD, R. [2006], “Simulation techniques for panels: Efficient importance sampling” (mit J.-F. Richard), in: Mátyás, L. und P. Sevestre (Hrsg.), *The Econometrics of Panel Data*, 3. Aufl., Kluwer Academic Publishers, erscheint demnächst.

MISSONG, M. [2003], “Household budget data and welfare comparisons - a reconciliation” (mit K. Kohn), in: Klein, I. und S. Mittnik (Hrsg.): *Contributions to modern econometrics - from data analysis to economic policy*, Kluwer, 135-150.

### **2.1.3 Buch-Veröffentlichungen**

MISSONG, M. [2004], *Demographisch gegliederte Nachfragesysteme und Äquivalenzskalen für Deutschland: Eine empirische Überprüfung neoklassischer Ansätze anhand der Daten der Einkommens- und Verbrauchsstichproben* (Habilitationsschrift), Duncker & Humblot.

### **2.1.4 Diskussionspapiere**

ASSMANN, C. [2006], “Determinants and costs of current account reversals under serial correlation and heterogeneity: a Bayesian approach.”

ASSMANN, C. und J. HOGREFE [2006], “Dynamic multi-sector CGE modelling with heterogenous capital and a consumption based pension system.”

ASSMANN, C., J. HOGREFE und R. LIESENFELD [2005], “The decline of the German output volatility: a Bayesian analysis.”

GOLOSNOY, V. [2006], “Flexible shrinkage in portfolio selection” (mit Y. Okhrin).

GOLOSNOY, V. [2006], “Modelling uncertainty in portfolio selection: a case-based decision approach” (mit Y. Okhrin).

GOLOSNOY, V. [2006], “Sequential monitoring of optimal portfolio weights” (mit W. Schmid und I. Yatsyshynets).

GOLOSNOY, V. und H. HERWARTZ [2006], “Semiparametric approach to the prediction of conditional correlation matrices in finance.”

HERWARTZ, H. [2003], “Analytical quasi maximum likelihood inference in multivariate volatility models” (mit C.M. Hafner), Econometric Institute Report EI 2003-21, Erasmus University Rotterdam.

HERWARTZ, H. [2003], “Testing for causality in variance using multivariate GARCH models” (mit C.M. Hafner), Universität Kiel, Economics Working Paper 2004-03.

- HERWARTZ, H. [2005], “Modelling the FIBOR/EURIBOR swap term structure: an empirical approach” (mit O. Blaskowitz und G. de Cadenas Santiago), Universität Kiel, Economics Working Paper 2005-04.
- HERWARTZ, H. [2005], “The introduction of the Euro and its effects on investment decisions” (mit R. Haselmann), Universität Kiel, Economics Working Paper 2005-15.
- HERWARTZ, H. [2006], “Modelling the Fisher hypothesis: world wide evidence” (mit H.-E. Reimers), Universität Kiel, Economics Working Paper 2006-04.
- HERWARTZ, H. und F. XU [2006], “Panel data model comparison for empirical saving-investment relations”, Universität Kiel, Economics Working Paper 2006-06.
- HERWARTZ, H. und F. XU [2006], “Reviewing the sustainability/stationarity of current account imbalances with tests for bounded integration”, Universität Kiel, Economics Working Paper 2006-07.
- HOGREFE, J. [2005], “The use of leading indicators for modeling and predicting the German industrial production – a Markov switching approach”, mimeo.
- HOGREFE, J. [2005], “Umverteilungswirkungen der Familienförderung,” Arbeitspapier 69, Lorenz-von-Stein-Institut für Verwaltungswissenschaften an der Universität Kiel.
- HOGREFE, J. [2006], “The yield spread and GDP growth – time varying leading properties and the role of monetary policy”.
- JENSEN, U. [2006]: “Measuring overeducation with earnings frontiers and multiply imputed censored income data” (mit H. Gartner und S. Rässler), IAB Discussion Paper 11/06, Nürnberg.
- JENSEN, U. [2006]: “The effects of collective bargaining on firm performance: new evidence based on stochastic production frontiers and multiply imputed German establishment data” (mit S. Rässler).
- JENSEN, U. [2006]: “Unproduktiv? Die Effekte von Branchentarifverträgen auf die Produktivität und Effizienz deutscher Betriebe” (mit S. Rässler).
- JENSEN, U. [2006]: “Weitersuchen? Die Determinanten ausbildungsinadäquater Beschäftigung” (mit H. Gartner und S. Rässler).
- LIESENFELD, R. [2003], “Identifying common long-range dependence in volume and volatility using high-frequency data”.
- LIESENFELD, R. [2004], “On the structural stability of U.S. GDP” (mit D.N. DeJong, H. Dharmarajan und J.-F. Richard).
- LIESENFELD, R. [2006], “Efficient likelihood analysis of state-space representations” (mit D.N. DeJong, H. Dharmarajan und J.-F. Richard).
- LIESENFELD, R. [2006], “Improving MCMC using efficient importance sampling” (mit J.-F. Richard).
- MISSONG, M. [2004], “On the public provision of the performing arts” (mit S. Traub).
- MISSONG, M. [2004], “Utility based regional equivalence scales” (mit Anja Rolf), Working Paper FE 0403, Institut für Ernährungswirtschaft und Verbrauchslehre, Christian-

Albrechts-Universität zu Kiel.

### 2.1.5 Sonstiges

HANSEN, G. [2005], “Wolfgang Wetzel in memoriam,” *Allgemeines Statistisches Archiv* 89/1, 95-97.

JENSEN, U. [2006], “Gute und schlechte Argumente für und gegen Studiengebühren,” *Christiana Albertina* 63, 28-44.

LIESENFELD, R. [2003], Kommentar zu M. Lechner: “Mikroökonomische Evaluation arbeitsmarktpolitischer Maßnahmen,” in: Franz, W., H.J. Ramser und M. Stadler (Hrsg.), *Empirische Wirtschaftsforschung: Methoden und Anwendungen*, Wirtschaftswissenschaftliches Seminar Ottobeuren, Band 32, Mohr Siebeck.

### 2.1.6 Herausgeberschaft

#### **Prof. Dr. Helmut Herwartz**

Associate Editor der Zeitschrift “Computational Statistics”

#### **Prof. Dr. Gerd Hansen**

“Advances in macroeconometric modeling”, Papers and Proceedings of the 3rd IWH Workshop in Macroeconometrics, Schriften des Instituts für Wirtschaftsforschung, Halle, Bd. 15, 2004, mit C. Dreger

## 2.2 Von Institutsmitgliedern gehaltene Vorträge

Im Berichtszeitraum wurden von den Institutsmitgliedern folgende externe wissenschaftliche Vorträge gehalten:

#### **Prof. Dr. Helmut Herwartz**

*Dezember 2003*: Erasmus-Universität, Rotterdam, Niederlande: “Testing for random effects under contemporaneous error correlation”

*September 2005*: NBER/NSF Time Series Conference, Universität Heidelberg: “Analysis of the Fisher hypotheses: world-wide evidence” (Poster)

*September 2005*: NBER/NST Time Series Conference, LMU München: “Nonparametric confidence intervals for value-at-risk”

*Dezember 2005*: Statistik-Seminar, Institut de statistique, UC Louvain, Belgien: “Testing for random effects in panel models with spatially correlated disturbances”

*Mai 2006*:: Sal. Oppenheim, Frankfurt: “Nonparametric inference on actual volatility”

*Mai 2006*: Frühjahrskonferenz, Deutsche Bundesbank: Diskussion von B. Baltagis Vortrag

*Juni 2006*: Forschungsseminar, Freie Universität Berlin: “Determinants of the saving investment relation – a new look at the Feldstein Horioka puzzle”

*August 2006:* Econometric Society European Meeting, Wien: “A functional coefficient approach to modeling the Fisher hypothesis: world wide evidence”

*August 2006:* Econometric Society European Meeting, Wien: “Testing for random effects in panel models with spatially correlated disturbances”

*August 2006:* Econometric Society European Meeting, Wien: “Testing for vector autoregressive dynamics under heteroskedasticity”

*August 2006:* Econometric Society European Meeting, Wien: “The introduction of the Euro and its effects on investment decisions”

*September 2006:* Conference on Recent Developments in Econometrics, Firenze, Italien: “What determines the relation between saving and investment? – a new look at the Feldstein Horioka puzzle”

*September 2006:* Statistische Woche, Dresden: “Testing for random effects in panel models with spatially correlated disturbances”

*December 2006:* Workshop on Econometrics and Computational Economics, Helsinki, Finnland: “Testing for random effects in panel models with spatially correlated disturbances”

#### **Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

*Juli 2003:* NBER Summer Institute NBER/NSF Forecasting Seminar, Cambridge, USA: “A structural break in U.S. output volatility? An encompassing analysis”

*März 2004:* Tagung des Ausschusses für Ökonometrie des Vereins für Socialpolitik, Rauschholzhausen: “A structural break in U.S. GDP?”

*November 2004:* Computational Finance Workshop, Universität Kiel: “Simulation-based inference of stochastic volatility models”

*Mai 2005:* Universität Konstanz: “Classical and Bayesian analysis of univariate and multivariate stochastic volatility models”

*Januar 2006:* Universität Kopenhagen, Dänemark: “Classical and Bayesian analysis of stochastic volatility models”

*Februar 2006:* Universität Tübingen: “Classical and Bayesian analysis of stochastic volatility models”

*Juni 2006:* Institut für Höhere Studien, Wien: “Efficient importance sampling for classical and Bayesian analysis of dynamic latent variable models”

*August 2006:* Econometric Society European Meeting, Wien: “Improving MCMC using efficient importance sampling”

#### **Prof. Dr. Gerd Hansen**

*November 2003:* Forschungsseminar, Universität Erlangen-Nürnberg: “Makroökonomie zwischen Wirtschaftstheorie und Datenanalyse”

*Februar 2006:* Universität Frankfurt/Main: Laudatio aus Anlass der Emeritierung von Prof. Dr. R. Hujer

**Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

*November 2006:* Workshop on Financial Surveillance, Universität Göteborg, Schweden: “Surveillance of minimum variance portfolio composition”

**PD Dr. Uwe Jensen**

*Juli 2003:* Forschungsseminar, Universität Erlangen-Nürnberg: “Misspecification preferred: the sensitivity of inefficiency rankings”

*September 2003:* European Workshop on Efficiency and Productivity Analysis, Oviedo, Spanien: “Measuring overeducation with earnings frontiers and panel data”

*September 2004:* Forschungsseminar, Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg: “Measuring overeducation: problems and solutions”

*Juni/Juli 2005:* European Workshop on Efficiency and Productivity Analysis, Brüssel, Belgien: “Where have all the data gone? Stochastic production frontiers with multiply imputed German establishment data”

*September 2005:* Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Bonn: “Where have all the data gone? Stochastic production frontiers with multiply imputed German establishment data”

*Oktober 2005:* Forschungsseminar, Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg: “Welche Uni ist denn nun die beste? Zur Genauigkeit von Hochschulranglisten”

*Juni 2006:* Forschungsseminar, Universität Wuppertal: “Measuring overeducation with earnings frontiers and multiply imputed censored income data”

*September 2006:* Conference on Recent Developments in Econometrics, Firenze, Italien: “Measuring overeducation with earnings frontiers and multiply imputed censored income data”

*September 2006:* Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Bayreuth: “Measuring overeducation with earnings frontiers and multiply imputed censored income data”

*Dezember 2006:* Nutzerkonferenz, Forschungsdatenzentrum (FDZ) der Bundesagentur für Arbeit, Nürnberg: “Measuring overeducation with earnings frontiers and multiply imputed censored income data”

**Dipl.-Volksw. Christian Aßmann**

*März 2006:* Nachwuchsworkshop der Deutschen Statistischen Gesellschaft, Berlin: “The decline in German output volatility: a Bayesian analysis”

*Dezember 2006:* Macroeconometric Workshop des DIW, Berlin: “Determinants and costs of current account reversals under serial correlation and heterogeneity: a Bayesian approach”

**Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe**

*Oktober 2004:* Jour Fixe, Zentrum für Sozialpolitik, Universität Bremen: “Umverteilungswirkungen der Familienförderung”

*Dezember 2004:* Forschungsseminar, Institut für Sozialpolitik und Finanzwissenschaft, Universität Kiel: “Umverteilungswirkungen der Familienförderung”

*September 2005:* Symposium “Das Kiel Tax-Benefit Microsimulation Model (KiTs): Methodik, Anwendung und Ergebnisse”, Lorenz-von-Stein-Institut, Universität Kiel: “Das deutsche Steuer- und soziale Sicherungssystem: Reformvorschläge und deren finanzielle Auswirkungen” (mit T. Drabinski)

*September 2006:* Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Bayreuth: “The decline in German output volatility: a Bayesian analysis”

*Dezember 2006:* Macroeconometric Workshop, DIW, Berlin: “The yield spread and GDP growth - time-varying leading properties and the role of monetary policy”

#### **M.Sc. Fang Xu**

*Juni 2006:* International Conference on Policy Modeling, Hong Kong, China: “What determines the relation between domestic saving and investment? – a new look at the Feldstein-Horioka Puzzle”

#### **Dipl.-Volksw. Florian Siedenburg**

*September 2006:* Baltic Business Development Conference, Stettin, Polen: “Determinants of current account imbalances in 16 OECD countries: An out-of-sample perspective”

## **2.3 Forschungsaufenthalte**

#### **Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

*September 2004:* University of Pittsburgh, USA

*September - Oktober 2005:* University of Pittsburgh, USA

*März 2006:* University of Pittsburgh, USA

#### **Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

*März 2006:* Universität Frankfurt/Oder

*Oktober 2006:* Universität Frankfurt/Oder

*November 2006:* Universität Göteborg, Schweden

#### **PD Dr. Uwe Jensen**

*September 2004:* Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg

*Oktober 2005:* Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg

*Dezember 2006:* Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg

## 2.4 Extern finanzierte Forschungsprojekte

### **Prof. Dr. Helmut Herwartz und Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

*2006-2007:* Förderung des Projekts “Lineare und nichtlineare Panelmodelle mit verallgemeinerter Fehlertermstruktur und ihre Anwendung bei der Analyse von Leistungsbilanzsalden” durch die Deutsche Forschungsgemeinschaft

### **Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

*2006:* Förderung des Projekts “Sequentielle Überwachung der optimalen Portfoliogewichte” (mit W. Schmid) durch die Deutsche Forschungsgemeinschaft

### **PD Dr. Uwe Jensen**

*2004:* Förderung des IAB-Projekts “Produktivitätsschätzungen mit dem IAB-Betriebspanel unter mehrfacher Ergänzung fehlender Daten” durch die Bundesagentur für Arbeit

*2005/06:* Förderung des IAB-Projekts “Mehrfache Ergänzung der rechtszensierten Lohn-  
daten in der IAB-Beschäftigtenstichprobe zur Schätzung von Einkommensfrontierfunktionen” durch die Bundesagentur für Arbeit

*2006/07:* Förderung des IAB-Projekts “Schätzung von Akzeptanzlöhnen mittels mehrfach  
ergänzter Lohn-  
daten aus der IAB-Beschäftigtenstichprobe und Einkommensfrontierfunktionen” durch die Bundesagentur für Arbeit

## 2.5 Aufenthalte von Gastwissenschaftlern

*August 2004:* D.N. DeJong, University of Pittsburgh, USA

*August 2004:* H. Weber, FU Berlin

*Dezember 2004:* S. Rässler, Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg

*Februar 2005:* C.M. Hafner, Erasmus-Universität, Rotterdam, Niederlande

*Mai 2005:* S. Rässler, Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung (IAB), Nürnberg

*August 2005:* J.-F. Richard, University of Pittsburgh, USA

## 2.6 Am Institut betreute wissenschaftliche Arbeiten

### 2.6.1 Habilitationen

#### **Erstgutachten**

Toker Doganoglu: “Essays in industrial organisation, marketing and financial econometrics,” 2006 (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

## 2.6.2 Dissertationen

### Erstgutachten

Jan Gottschalk: “Monetary policy and the German unemployment problem in macroeconomic models – theory and evidence,” 2004 (Gutachter: Prof. Dr. G. Hansen)

Julia Körner: “Intertemporale Optimierung, Marktmacht und Wettbewerbsverhalten: Essays zur Preisbildung im deutschen Kaffeemarkt,” 2003 (Gutachter: Prof. Dr. G. Hansen)

### Zweitgutachten

Björn Christensen: “Reservationslöhne und Arbeitslosigkeit in Deutschland,” 2004 (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Markus Haas: “Dynamic mixture models models for financial time series,” 2004 (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld).

Christophe Kamps: “The dynamic macroeconomic effects of public capital,” 2004 (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Bukhari M.S. Sillah: “Banking and economic growth: case of the Gambia”, 2005 (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Elmar Zschischang: “Genetisches Programmieren als neues Instrumentarium zur Prognose makroökonomischer Größen: Anwendungen auf Inflationsraten und Wechselkurse,” 2004 (Gutachter: Prof. Dr. G. Hansen)

## 2.6.3 Diplomarbeiten

Christian Aßmann: “Timing and detecting structural breaks,” 2004 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Kirsten Ingrun Iversen: “Stigmas und Scars: Ein Ost-West-Vergleich der nachteiligen Auswirkungen von Arbeitslosigkeit in Deutschland,” 2004 (Betreuer: PD Dr. U. Jensen)

Jochen Krause: “Multivariate dynamische Mixmodelle für Finanzmarktzeitreihen”, 2005 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Liv Neumann: “Realized volatility,” 2005 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Adriana Nicolae: “Specification tests for count data models”, 2006 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Anja Rolf: “Gibt es den ‘repräsentativen’ deutschen Konsumenten?“, 2003 (Betreuer: Prof. Dr. G. Hansen)

Roxana Schaper: “Die Diskretheit von Transaktionspreisen auf Finanzmärkten,” 2005 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Florian Siedenbug: “An empirical analysis of the determinants of the current account” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Martin Siegel: “Empirische Untersuchungen zur Querschnittskorrelation im europäischen Bankensektor” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)



Kreshna Syuhada: “Neo-normal stochastic volatility models,” 2004 (Master of Science Thesis, Curtin University of Technology, Perth, Australia, Examiner: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Yi Zeng: “Der Zusammenhang zwischen Vermögen und Einkommensunsicherheit. Eine Studie anhand chinesischer Haushaltspanels und -querschnitte,” 2003 (Betreuer: Prof. Dr. G. Hansen)

## 2.7 Laufende Dissertationsprojekte

Christian Aßmann: “Die Bedeutung des Leistungsbilanzdefizits: Eine empirische Analyse” (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Asta Aviete: “Is there a decline in job stability in Germany: a subgroup analysis” (Betreuer: PD Dr. U. Jensen)

Christina Boll: “Frauenerwerbstätigkeit in Deutschland” (Betreuer: PD Dr. U. Jensen)

Hariharan Dharmarajan: “Efficient estimation of state space models” (Reader: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Jens Hogrefe: “Modeling and forecasting business cycles” (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Fang Xu: “An empirical investigation of the relation between domestic saving and investment by means of functional coefficient model” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

## 2.8 Statistisch-ökonomisches Seminar

Im statistisch-ökonomischen Forschungsseminar wurden im Berichtszeitraum folgende Vorträge gehalten.

### 2.8.1 Wintersemester 2003/04

PD Dr. Uwe Jensen (ISÖ): “Measuring overeducation with stochastic earnings frontiers and panel data”

Dr. Julia Körner (Institut für Ernährungswirtschaft und Verbrauchslehre): “The dark side of coffee”

PD Dr. Stefan Traub (Institut für Finanzwissenschaft, CAU): “Relative deprivation, personal income satisfaction, and average well-being under different income distributions”

Dr. Carsten Trenkler (Humboldt-Universität, Berlin): “Integration across borders: The Polish interwar economy 1921–1937”

Dipl.-Volksw. Oliver Blaskowitz (Humboldt-Universität, Berlin): “Probability Trading”

Dr. Nikolaus Hautsch (Universität Konstanz): “Latent factor models for dynamic intensity processes”

M.Sc. Deniz Dilan Karaman (Humboldt-Universität, Berlin): “Comparison of two panel cointegration tests”

Dipl.-Kffr. Kerstin Lange (ISÖ): “Demand for national long-distance voice telephony: Estimating tariff choices of individual households”

M.Sc. Fang Xu (ISÖ): “Consumption, wealth and stock returns”

Dr. Robert Jung (Universität Tübingen): “Parameter estimation in some time-series models with discrete support”

PD Dr. Martin Missong (ISÖ): “Regionale Kaufkraftparitäten”

MA Matthias Deschryvere (PHD candidate, Quantitative Economics, CAU): “Micro modeling of health and retirement decisions”

Dipl.-Kfm. Tobias Rosenkranz (ISÖ): “Bootstrap-Methoden in heteroskedastischen Regressionsmodellen”

### **2.8.2 Sommersemester 2004**

Prof. Dr. Helmut Herwartz (ISÖ): “Schätzung des CAPM bei zeitinhomogener Kovarianzstruktur” (Antrittsvorlesung)

Prof. Dr. Roman Liesenfeld (ISÖ): “Monte-Carlo-Methoden in der empirischen Wirtschaftsforschung” (Antrittsvorlesung)

Dipl.-Math. Christine Ebling (Lehrstuhl für Absatzwirtschaft, CAU): “Die Berücksichtigung von dynamischen Aspekten in der Modellierung von Konsumentenverhalten”

Dipl.-Kfm. Tobias Maria Günter (Lehrstuhl für Absatzwirtschaft, CAU): “Zeitreihenanalyse im Marketing”

Dipl.-Math. Ingmar Nolte (Universität Konstanz): “Modeling a multivariate transaction process”

Dipl.-Volksw. Björn Christensen (Institut für Weltwirtschaft): “Reservationslöhne und Arbeitslosigkeit in Deutschland”

Dipl.-Kffr. Kerstin Lange (ISÖ): “Estimating models of long-distance carrier choice and cost of using alternatives”

Dipl.-Kfm. Tobias Rosenkranz (ISÖ): “Methoden zur Verbesserung des Irrtumsniveaus und der Effizienz von Tests in heteroskedastischen Regressionsmodellen”

Dr. Kai Carstensen (Institut für Weltwirtschaft): “Assessing and improving the small-sample performance of nearly efficient unit root tests”

Dipl.-Volksw. Christophe Kamps (Institut für Weltwirtschaft): “The dynamic effects of public capital in OECD countries: A panel VAR analysis”

Prof. Dr. Winfried Pohlmeier (Universität Konstanz): “Returns to schooling: What do we know and what should we know?”

### **2.8.3 Wintersemester 2004/05**

Kirsten Iversen (ISÖ): “Stigmas and scars: Individuelle Auswirkungen der Arbeitslosigkeit in Deutschland”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Timing and detecting structural breaks”

Dipl.-Volksw. Markus Krätzig (Humboldt-Universität, Berlin): “JStatCom – software development for econometrics”

Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe (ISÖ): “Markov-switching-Modelle in der Konjunkturforschung”

Dr. Sönke Jost Siemßen (WestLB Asset Management Kapitalanlagegesellschaft mbH, Düsseldorf): “Fundamentale Einflussfaktoren auf die Bund-Rendite”

M.Sc. Rainer Haselmann (Handelshochschule Leipzig): “Einflüsse der Euroeinführung auf das Investitionsverfahren europäischer Anleger”

PD Dr. Susanne Rässler (Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung, Nürnberg): “Behandlung fehlender Werte in Umfragen”

Dipl.-Volksw. Oliver Blaskowitz (Humboldt-Universität, Berlin): “Modelling the EURIBOR swap term structure: an empirical approach”

M.Sc. Fang Xu (ISÖ): “An empirical investigation about the stationarity of current account”

M.Sc. Deniz Dilan Karaman (Humboldt-Universität, Berlin): “Maximum likelihood based panel cointegration test with linear time trend and Fisher hypothesis”

M.A. Bukhari Sillah (PHD candidate, Quantitative Economics, CAU): “Banking and economic growth: The Gambia as a case study”

Dr. Christian Hafner (Erasmus-Universität, Rotterdam, Niederlande): “Modelling asymmetry in correlation dynamics using common factors”

#### **2.8.4 Sommersemester 2005**

Dipl.-Kfm. Tobias Rosenkranz (ISÖ): “Analyse von Über- und Unterausbildungseffekten unter Berücksichtigung heteroskedastischer Störgrößen”

Dr. Toker Doganoglu (Ludwig-Maximilian-Universität, München): “Estimating network effects: A semiparametric approach”

Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe (ISÖ): “The decline in German output volatility: A Bayesian analysis”

Dr. Thomas Kaiser (KPMG, Frankfurt): “Operationelle Risiken: Überblick und Anwendungsbereiche statistisch-ökonomischer Verfahren”

MBA Ruipeng Liu (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “Long memory in financial time series: Estimation of the bivariate multi-fractal model and its application to value-at-risk”

M.Sc. Fang Xu (ISÖ): “What influences the savings-investment relation? – a review of the Feldstein-Horioka puzzle”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “The impact of current account reversals on economic growth: A panel probit analysis under serial correlation”

### 2.8.5 Wintersemester 2005/06

Prof. Dr. Ingo Klein (Universität Nürnberg-Erlangen): “Schwach, mittel und stark in der deskriptiven Statistik – eine Bayesianische Analyse”

Prof. Dr. Jürgen Wolters (FU Berlin): “Ist das Konzept der inflationsstabilen Arbeitslosenquote mit den (deutschen) Daten vereinbar?”

Prof. Dr. Helmut Herwartz (ISÖ): “Test auf zufällige Individualeffekte in stationären Panels bei kontemporärer Fehlerkorrelation”

Dr. Annekatrien Niebuhr (Institut für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung, Kiel): “Agglomeration, spatial interaction and convergence in the EU”

Dipl.-Kfm. Daniel Drescher (ISÖ): “GLARMA-Modelle für Zählzeitreihen”

Prof. Dr. Gerd Ronning (Universität Tübingen): “Microeconomic evaluation in case of misclassified treatment”

M.A. Israel Waichmann (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “Econometrics of experimental economics – the case of Cournot oligopoly”

Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe (ISÖ): “Prognose von konjunkturellen Wendepunkten mit Hilfe dynamischer Faktormodelle”

Dr. Matthias Fengler (Sal. Oppenheim, Frankfurt): “Arbitrage-free smoothing of implied vola surfaces”

Florian Siedenburg (ISÖ): “Determinanten von Leistungsbilanzsalden”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Sudden stops and current account reversals: A multinomial Probit analysis with unobserved heterogeneity”

### 2.8.6 Sommersemester 2006

Prof. Andy Tremayne (University of Sydney, Australien): “Integer autoregression: Higher order models, overdispersion and applications”

Dipl.-Kfm. Tobias Rosenkranz (ISÖ): “Analyse von Überqualifikation und Lohndispersion”

PD Dr. Friedhelm Pfeiffer (Zentrum für Europäische Wirtschaftsforschung, Mannheim): “Abschreibungsraten allgemeiner und beruflicher Ausbildungsinhalte: Empirische Evidenz auf Basis subjektiver Einschätzungen”

M.Sc. Fang Xu (ISÖ): “Reviewing the sustainability/stationarity of current account imbalances with tests for bounded integration”

Dipl.-Volksw. Henning Weber (Freie Universität, Berlin): “How much and how fast do trade costs change with EMU? Panel evidence from sectoral data”

Prof. Dr. Reinhard Hujer (Universität Frankfurt/Main): “Evaluation der aktiven Arbeitsmarktpolitik in Deutschland: Stand der empirischen Forschung”

Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe (ISÖ): “Yield spread and GDP growth - time varying leading properties”

Dipl.-Ing. Timur Yusupov (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “Revealed transaction costs and market efficiency: An example of the Tokyo Stock Exchange”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Identification of current account reversals via Markov switching models”

### **2.8.7 Wintersemester 2006/07**

Dipl.-Soz.-Ök. Gunter Bahr (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “Sustainability – is it contagious?”

PD Dr. Matthias Staat (Universität Mannheim): “Effizienzvergleiche für Facharztgruppen”

Dipl.-Ing. agr. Arne Henningsen (Institut für Agrarpolitik, CAU): “Ökonometrische Schätzung von mikroökonomisch konsistenten Unternehmens-Haushalts-Modellen bei imperfekten Arbeitsmärkten”

M.A. Guilherme Valle Moura (ISÖ): “Comparing solution methods for the neoclassical growth model with labor choice”

M.Sc. Fang Xu (ISÖ): “Inference in functional coefficient models: A comparison of competing bootstrap approaches”

Dr. Jeong-Ryeol Kurz-Kim (Deutsche Bundesbank, Frankfurt): “Exact inference and optimal invariant estimation for the stability parameter of symmetric alpha-stable distributions using Monte Carlo methods”

Dipl.-Volksw. Lars Edler (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “Kohonen’s self-organizing maps: Do geometrical patterns contain information about the future?”

Adriana Nicolae (ISÖ): “Specification tests for count data models”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Diagnostic tests and efficient estimation for panel probit models”

Dipl.-Volksw. Florian Siedenburg (ISÖ): “Robust bootstrap panel unit root tests”

Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe (ISÖ): “Improving real-time GDP data: A mixed frequency approach”

Dr. Günter Coenen (Europäische Zentralbank, Frankfurt): “DSGE models for policy analysis and forecasting”

Prof. Dr. Norbert Janz (Fachhochschule Aachen): “What drives productivity in Tanzanian manufacturing firms: Technology or institutions?”

## 3 Lehre

Unser Institut bietet eine breite Palette von Lehrveranstaltungen an und verantwortet 4 der 13 an der Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Fakultät vorgesehenen Pflichtveranstaltungen im Grundstudium. Und, wie die Traumvorlesungsumfragen belegen, bieten wir auch aus Sicht der Studenten nicht nur Quantität.

### 3.1 Lehrveranstaltungen

In der letzten Spalte finden Sie jeweils die Semesterwochenstunden.

#### 3.1.1 Sommersemester 2003

Statistik			
Christiansen	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Lange	Übung zur Methodenlehre der Statistik I	UE	2
Paolella	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Paolella	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Jensen	Multivariate Methods (KISS, PHD)	V/UE	2
Mittnik	Multivariate Time Series Analysis (PHD)	V/UE	2
Paolella	Empirical Methods in Finance (KISS)	V	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Rosenkranz	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Rosenkranz	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Rosenkranz	Ökonometrische Software	V/UE	2
Herwartz	Econometric Analysis of Panel Data (PHD)	S	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis	UE	2
Jensen	Lineare Algebra	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.2 Wintersemester 2003/04

Statistik			
Christiansen	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Lange	Übung zur Methodenlehre der Statistik II	UE	2
Christiansen			
Novotny	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene II	V	4
Liesenfeld	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene II	UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie I	V	4
Rosenkranz	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Xu	Ökonometrische Software	UE	2
Hansen	Ökonometrische Nachfrageanalysen	V/UE	2
Herwartz	Econometrics (PHD)	V	2
Herwartz	Projektseminar	S	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Analysis, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.3 Sommersemester 2004

Statistik			
Missong	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Lange	Übung zur Methodenlehre der Statistik I, 1. Gruppe	UE	2
Missong	Übung zur Methodenlehre der Statistik I, 2. Gruppe	UE	2
Missong			
Novotny	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Hogrefe	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Jensen	Multivariate Methods (KISS, PHD)	V/UE	2
Liesenfeld	A Practical Course in Empirical Economics (KISS)	V/UE	2
Liesenfeld	Ausgewählte Probleme der empirischen Wirtschaftsforschung	S	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Rosenkranz	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Xu	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Rosenkranz			
Xu	Ökonometrische Software II	V/UE	2
Herwartz	Econometric Methods (PHD)	V	2
Herwartz	Time Series Analysis (KISS)	V	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis	UE	2
Jensen	Lineare Algebra	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1



### 3.1.4 Wintersemester 2004/05

Statistik			
Missong	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Aßmann	Übung zur Methodenlehre der Statistik II	UE	2
Missong			
Büther	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene II	V	4
Hogrefe	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene II	UE	2
Liesenfeld	Mikroökometrie	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik der Finanzmärkte	V/UE	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie I	V	4
Xu	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Rosenkranz	Ökonometrische Software	UE	2
Carstensen	Makroökometrische Modelle	V/UE	2
Herwartz	Analyse von Paneldaten	V/UE	2
Herwartz			
Rosenkranz	Econometric Methods (PHD)	V/UE	2
Herwartz	Projektseminar	S	2
Herwartz	Ökonometrisches Seminar	S	2
Missong	Ökonometrische Nachfrageanalysen	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Analysis, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.5 Sommersemester 2005

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Aßmann	Übung zur Methodenlehre der Statistik I	UE	2
Aßmann			
Hogrefe	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Hogrefe	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Hogrefe	Statistik mit MATLAB, Computerübung	UE	
Jensen	Multivariate Methods (KISS, PHD)	V/UE	2
Liesenfeld	A Practical Course in Empirical Economics (PHD, KISS)	V/UE	2
Liesenfeld	Simulation based Inference	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Rässler	Markov-Chain Monte-Carlo Methods	V	1
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Xu	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Rosenkranz	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Rosenkranz			
Xu	Ökonometrische Software II	V/UE	2
Herwartz	Econometrics of Financial Markets (KISS)	V/UE	2
Herwartz			
Rosenkranz			
Xu	Selected Fields in Econometrics (PHD)	S	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis	UE	2
Jensen	Lineare Algebra	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.6 Wintersemester 2005/06

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Aßmann	Übung zur Methodenlehre der Statistik II	UE	2
Aßmann			
Hogrefe	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene II	V	4
Hogrefe	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene II	UE	2
Liesenfeld	Mikroökonomie	V/UE	2
Liesenfeld	Statistics for Financial Markets (PHD)	V/UE	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie I	V	4
Rosenkranz	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Rosenkranz			
Xu	Ökonometrische Software	UE	2
Herwartz	Applied Time Series Analysis (PHD)	V/UE	2
Herwartz			
Xu	Projektseminar: Prognose von Gesundheitsausgaben	S	2
Herwartz	Ökonometrisches Seminar	S	2
Xu	Tutorial: Introductory Course of Econometrics (PHD)	UE	1
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Analysis, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.7 Sommersemester 2006

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Hogrefe	Übung zur Methodenlehre der Statistik I	UE	2
Aßmann			
Hogrefe	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Aßmann	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Golosnoy	Sequential Methods in Economics and Finance (PHD)	V/UE	2
Hogrefe	Statistik mit MATLAB, Computerübung	UE	2
Jensen	Multivariate Methods (KISS, PHD)	V/UE	2
Liesenfeld	A Practical Course in Empirical Economics (PHD, KISS)	V/UE	2
Liesenfeld	Simulation based Inference	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Rosenkranz	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Xu	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Rosenkranz			
Xu	Ökonometrische Software II	V/UE	2
Herwartz	Panel Data Model (KISS)	V/UE	2
Herwartz			
Rosenkranz			
Xu	Selected Fields in Econometrics (PHD)	V	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis	UE	2
Jensen	Lineare Algebra	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.8 Wintersemester 2006/07

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Hogrefe	Übung zur Methodenlehre der Statistik II	UE	2
Aßmann			
Hogrefe	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene II	V	4
Aßmann	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene II	UE	2
Liesenfeld	Mikroökonomie	V/UE	2
Liesenfeld	Statistics for Financial Markets (PHD)	V/UE	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie I	V	4
Xu	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Xu	Ökonometrische Software	UE	2
Herwartz	Econometrics of Financial Markets (PHD)	V/UE	2
Herwartz			
Xu	Projektseminar: Inflation Forecasting (PHD)	S	2
Herwartz	Ökonometrisches Seminar	S	2
Xu	Tutorial: Introductory Course of Econometrics (PHD)	UE	1
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Analysis, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Lineare Algebra, 2. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 1. Gruppe	UE	2
Jensen	Vorkurs, 2. Gruppe	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### **3.1.9 Sonstige Lehrveranstaltungen**

#### **Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe**

*Dezember 2004*: “Markov Switching Models,” Kurs im Rahmen des Advanced Studies Programs des Instituts für Weltwirtschaft, Kiel

### **3.2 Auszeichnungen**

Im Berichtszeitraum wurden von Institutsmitgliedern in der ‘Traumvorlesungs’-Umfrage der Fachschaftsvertretung der Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Fakultät folgende erste Plätze belegt:

#### **Sommersemester 2003**

Grundstudium:

1. Dr. S. Christiansen (Methodenlehre der Statistik I)

Hauptstudium:

1. PD Dr. U. Jensen (Multivariate Methods)

3. PD Dr. U. Jensen (Labor Econometrics)

#### **Wintersemester 2003/04**

Grundstudium:

1. Dr. S. Christiansen (Methodenlehre der Statistik II)

Hauptstudium:

2. Dr. S. Christiansen (International Financial Markets)

#### **Sommersemester 2004**

Grundstudium:

1. PD Dr. M. Missong (Methodenlehre der Statistik I)

Hauptstudium:

1. PD Dr. U. Jensen (Labor Econometrics)

#### **Wintersemester 2004/05**

Grundstudium:

1. PD Dr. M. Missong (Methodenlehre der Statistik II)

#### **Sommersemester 2005**

Hauptstudium:

3. PD Dr. U. Jensen (Labor Econometrics)

#### **Wintersemester 2005/06**

Hauptstudium:

1. Prof. Dr. Helmut Herwartz (Applied Time Series Analysis)

### **Sommersemester 2006**

Grundstudium:

3. PD Dr. U. Jensen (Lineare Algebra)

Hauptstudium:

2. Prof. Dr. Roman Liesenfeld (A Practical Course in Empirical Economics)

### **3.3 Externe Nutzung unseres PC-Labors**

Das PC-Labor unseres Instituts wird nicht nur für zahlreiche, im Abschnitt 3.1 dokumentierte Lehrveranstaltungen unseres Instituts genutzt, sondern auch für diverse andere Veranstaltungen, wie folgende Auswahl zeigt:

#### **Sommersemester 2003**

T.M. Günter (Lehrstuhl für Absatzwirtschaft): SPSS-Kurs

#### **Sommersemester 2004**

H. Herrmann (Institut für Regionalforschung): “Methoden der empirischen Regionalforschung II”

C. Pierzdioch (Institut für Weltwirtschaft)

#### **Wintersemester 2004/05**

T. Yusupov (Institut für Volkswirtschaftslehre): “Empirical analysis of high frequency data”

#### **Sommersemester 2005**

T.M. Günter (Lehrstuhl für Absatzwirtschaft): SPSS-Kurs

H. Herrmann (Institut für Regionalforschung): “Methoden der empirischen Regionalforschung II”

M. Jungmann (Lehrstuhl für Gründungs- und Innovationsmanagement)

C. Kamps (Institut für Weltwirtschaft): “Numerical methods in macroeconometrics”

M. Maurin (MTP)

#### **Wintersemester 2005/06**

Dennis Proppe (Lehrstuhl für Innovation, neue Medien und Marketing): “Marketing mit Excel”

Arthem Korzhenevych (Institut für Regionalforschung): “CGE-Analysis”

#### **Sommersemester 2006**

H. Herrmann (Institut für Regionalforschung): “Methoden der empirischen Regionalforschung II”

### **Wintersemester 2006/07**

Friedrich Wagner (Lehrstuhl für Geld, Wahrung und Internationale Finanzmarkte): “Introduction to MATLAB in applications to financial markets”

Roland Winkler (Lehrstuhl für Makroökonomik): Seminar “Dynamische Makroökonomik”

Andrea Schertler (Lehrstuhl für Finanzwirtschaft): “Investition und Finanzierung”



## 4 Weitere Aktivitäten

### 4.1 Konferenzorganisation

**Prof. Dr. Gerd Hansen**

- Mitorganisation des Festkolloquiums aus Anlass der Emeritierung von Prof. Dr. R. Hujer, Universität Frankfurt/Main

### 4.2 Gutachtertätigkeit

Im Berichtszeitraum wurden von Institutsmitgliedern Gutachten für die folgenden Fachzeitschriften, Forschungsförderungsinstitutionen, etc. erstellt:

#### 4.2.1 Gutachten für Fachzeitschriften

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

- Allgemeines Statistisches Archiv
- Econometric Reviews
- Empirical Economics
- International Economics and Economic Policy
- Japan and the World Economy
- Journal of Econometrics
- Journal of International Money and Finance
- Review of Economics and Statistics
- Review of Economic Studies
- Spatial Economic Analysis

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

- Allgemeines Statistisches Archiv
- Econometric Reviews
- Empirical Economics
- International Economic Review
- Journal of Applied Econometrics
- Journal of Business and Economics Statistics
- Journal of Econometrics
- Journal of Empirical Finance
- Journal of Futures Markets
- Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics
- The Econometrics Journal
- Zeitschrift für Betriebswirtschaftliche Forschung

**PD Dr. Uwe Jensen**

- Computational Statistics & Data Analysis
- Empirical Economics
- International Journal of Manpower
- Journal of Productivity Analysis
- Statistical Papers

**Dipl.-Volksw. Christian Aßmann**

- Journal of Business & Economic Statistics

**M.Sc. Fang Xu**

- Economics Bulletin
- 33rd Annual Meeting of the European Finance Association

**4.2.2 Sonstige Gutachten**

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

- Danish National Research Foundation: Einzelanträge
- Deutsche Forschungsgemeinschaft: Einzelanträge
- Fonds zur Förderung der wissenschaftlichen Forschung: Einzelanträge

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

- Deutsche Forschungsgemeinschaft:
  - Einzelanträge
  - Graduiertenkollegs

**Prof. Dr. Gerd Hansen**

- Deutsche Forschungsgemeinschaft:
  - Sonderforschungsbereiche
  - DFG-Schwerpunktprogramme
  - Einzelanträge
- Leibniz-Gemeinschaft: Evaluation
- Gutachten im Rahmen eines Excellence-Cluster-Antrages
- Gutachten über Berufungslisten von Universitäten
- Gutachten über Abteilungen des Instituts für Weltwirtschaft

**4.3 Mitgliedschaften**

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

- Econometric Society
- Verein für Socialpolitik (Ausschuss für Ökonometrie)

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

- Econometric Society
- Verein für Socialpolitik (Ausschuss für Ökonometrie)

**Prof. Dr. Gerd Hansen**

- Deutsche Statistische Gesellschaft
- Econometric Society
- European Economic Association
- International Statistical Institute
- Verein für Socialpolitik
- Wissenschaftlicher Beirat des IfW Kiel, bis April 2004

**Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

- Deutsche Statistische Gesellschaft

**PD Dr. Uwe Jensen**

- Deutsche Statistische Gesellschaft
- Econometric Society
- Institute of Mathematical Statistics
- Productivity Analysis Research Network
- Verein für Socialpolitik

**Dipl.-Volksw. Christian Aßmann**

- Deutsche Statistische Gesellschaft

**Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe**

- Verein für Socialpolitik

**M.Sc. Fang Xu**

- European Economic Association

## **4.4 Akademische Selbstverwaltung**

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

- Auswahlkommission des Doctoral Programmes 'Quantitative Economics' der Universität Kiel, 2004
- Stellvertreter im Informationsausschuss des Senats, seit 2004
- Prodekan seit Juli 2006

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

- Auswahlkommission des Doctoral Programmes 'Quantitative Economics' der Universität Kiel, 2005

- Vertreter im Senatsausschuss 'Lektorat Deutsch für Ausländer', seit 2006
- Stellvertreter im Senatsausschuss für Technologietransfer, seit 2006

**Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

- Auswahlkommission des Doctoral Programmes 'Quantitative Economics' der Universität Kiel, 2006

**PD Dr. Uwe Jensen**

- Auswahlkommission des Doctoral Programmes 'Quantitative Economics' der Universität Kiel, 2003
- Stellvertreter im Informationsausschuss des Senats, 2003

## 4.5 Populärwissenschaftliche Vorträge

**PD Dr. Uwe Jensen**

*Mai 2004:* 'Night of the Profs', Universität Kiel: "Verdienen Sie, was Sie verdienen?"

*November 2004:* Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Plön: "Warum steigt mit dem Einkommen nicht die Zufriedenheit?"

*November 2005:* 'Night of the Profs', Universität Kiel: "Gute und schlechte Argumente für und gegen Studiengebühren – and the winner is..."

*Februar 2006:* International Center, Universität Kiel: "Studiengebühren im Ausland und für Ausländer"

*März 2006:* Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Itzehoe: "Welche Uni ist denn nun die beste? Zur Genauigkeit von Hochschulranglisten"

## 4.6 Interviews

**PD Dr. Uwe Jensen**

*November 2005:* "Bildung gegen Bares", *man in the city* (Kiel), 30 - 31.