

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

Tätigkeitsbericht

2007 - 2010

# Vorwort

Dieser Tätigkeitsbericht der Jahre 2007 bis 2010 soll die Leistungen des Instituts für Statistik und Ökonometrie (ISÖ) in Forschung und Lehre aufzeigen. Er schließt direkt an den [Tätigkeitsbericht der Jahre 2003 bis 2006](#) an. Sollten Sie also etwas in diesem aktuellen Tätigkeitsbericht nicht finden, so schlagen Sie bitte auch im vorangehenden Bericht nach.

# 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 . . . . .	6
2.1.3	Buch-Veröffentlichungen . . . . .	7
2.1.4	Diskussionspapiere . . . . .	7
2.1.5	Sonstiges . . . . .	9
2.1.6	Herausgeberschaft . . . . .	9
2.2	Von Institutsmitgliedern gehaltene Vorträge . . . . .	9
2.3	Preise und Auszeichnungen . . . . .	14
2.4	Forschungsaufenthalte . . . . .	14
2.5	Extern finanzierte Forschungsprojekte . . . . .	15
2.6	Aufenthalte von Gastwissenschaftlern . . . . .	16
2.7	Am Institut betreute wissenschaftliche Arbeiten . . . . .	16
2.7.1	Dissertationen . . . . .	16
2.7.2	Diplomarbeiten . . . . .	17
2.7.3	Bachelorarbeiten . . . . .	19
2.8	Laufende Dissertationsprojekte . . . . .	19
2.9	Statistisch-ökonomisches Seminar . . . . .	20
2.9.1	Wintersemester 2006/07 . . . . .	20
2.9.2	Sommersemester 2007 . . . . .	20
2.9.3	Wintersemester 2007/08 . . . . .	21
2.9.4	Sommersemester 2008 . . . . .	22
2.9.5	Wintersemester 2008/09 . . . . .	22
2.9.6	Sommersemester 2009 . . . . .	23
2.9.7	Wintersemester 2009/10 . . . . .	23
2.9.8	Sommersemester 2010 . . . . .	24
2.9.9	Wintersemester 2010/11 . . . . .	24
<b>3</b>	<b>Lehre</b>	<b>25</b>
3.1	Lehrveranstaltungen . . . . .	25
3.1.1	Wintersemester 2006/07 . . . . .	25
3.1.2	Sommersemester 2007 . . . . .	26
3.1.3	Wintersemester 2007/08 . . . . .	27
3.1.4	Sommersemester 2008 . . . . .	28
3.1.5	Wintersemester 2008/09 . . . . .	29

3.1.6	Sommersemester 2009	30
3.1.7	Wintersemester 2009/10	31
3.1.8	Sommersemester 2010	32
3.1.9	Wintersemester 2010/11	33
3.1.10	Sonstige Lehrveranstaltungen	33
3.2	Auszeichnungen	34
3.3	Extern finanzierte Lehrprojekte	34
3.4	Externe Nutzung unseres PC-Labors	34
3.5	Aufenthalte von Gästen	35
<b>4</b>	<b>Weitere Aktivitäten</b>	<b>36</b>
4.1	Konferenzorganisation	36
4.2	Gutachtertätigkeit	36
4.2.1	Gutachten für Fachzeitschriften	36
4.2.2	Sonstige Gutachten	38
4.3	Mitgliedschaften	38
4.4	Akademische Selbstverwaltung	39
4.5	Populärwissenschaftliches	39

# 1 Organisation des Instituts

Das Team des Instituts bestand im Januar 2011 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. habil. Vasyl Golosnoy

## Kursbeauftragter Mathematik

Prof. Dr. Uwe Jensen

## Betreuer der Rechenanlage

Albrecht Mengel, Dipl.-Informatiker

## Wissenschaftliche Mitarbeiter

Dr. Fang Xu

Bastian Gribisch, Dipl.-Volksw.

Matthias Hartmann, Dipl.-Volksw.

Markus Pape, Dipl.-Volksw.

Jan Roestel, Dipl.-Volksw.

Christoph Strumann, Dipl.-Volksw.

Malte Rengel, Dipl.-Volksw.

Yabibal Muluaem Walle, M.Sc.

## Sekretärinnen

Ilse Plaep (Ökonometrie)

Angelika Reinmüller (Statistik)

## Studentische und wissenschaftliche Hilfskräfte

Christian Fontius    Stephanie Glaser

Juliana Huppertz    Sebastian Müller

Marcus Pawel    Anja Rossen

Julian Schröder    Dirk Stolle

Jan Vogler

## 2 Forschung

Die Forschung am Institut konzentriert sich auf die folgenden Gebiete der empirischen Wirtschaftsforschung. Eine detailliertere Darstellung enthält der [Forschungsbericht](#) des Instituts. Eine Auswahl aktueller Forschungsergebnisse in Posterform finden Sie auch in unserer [Bildergalerie zur empirischen Wirtschaftsforschung](#).

- 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

### 2.1 Publikationen

Im Berichtszeitraum wurden von den Institutsmitgliedern folgende Arbeiten veröffentlicht:

#### 2.1.1 Aufsätze in Fachzeitschriften

ASSMANN, C. [2009]: “Statistical agreement and cost-benefit: Comparison of methods for constructing growth reference charts” (mit M. Hermanussen und J. Tutkuvienė), *The Annals of Human Biology*, erscheint demnächst.

ASSMANN, C. und J. BOYSEN-HOGREFE [2009], “Analysis of current account reversals via regime switching models,” *Economic Change and Restructuring*, erscheint demnächst.

- ASSMANN, C. und J. HOGREFE [2009], “Dynamic multi-sector CGE modeling and the specification of capital: Comment on Farmer and Wendner (2004),” *Structural Change and Economic Dynamics* 20, 74-75.
- ASSMANN, C., J. HOGREFE und R. LIESENFELD [2008], “The decline in German output volatility: a Bayesian analysis,” *Empirical Economics* 37, 653-679.
- GOLOSNOY, V. [2007], “EWMA control charts for monitoring optimal portfolio weights” (mit W. Schmid), *Sequential Analysis* 26, 195-224.
- GOLOSNOY, V. [2007], “Multivariate shrinkage for optimal portfolio weights” (mit Y. Okhrin), *European Journal of Finance* 13, 441-458.
- GOLOSNOY, V. [2007], “Sequential monitoring of minimum variance portfolio,” *AStA Advances in Statistical Analysis* 91, 39-55.
- GOLOSNOY, V. [2008], “Modelling uncertainty in portfolio selection: a case-based decision approach” (mit Y. Okhrin), *Journal of Economic Behavior and Organization* 67, 718-734.
- GOLOSNOY, V. [2009], “Flexible shrinkage in portfolio selection” (mit Y. Okhrin), *Journal of Economic Dynamics and Control* 33, 317-328.
- GOLOSNOY, V. [2009], “Multivariate CUSUM charts: properties and enhancements” (mit S. Ragulin und W. Schmid), *AStA Advances in Statistical Analysis* 93, erscheint demnächst.
- GOLOSNOY, V. [2009], “New characteristics for portfolio surveillance” (mit I. Okhrin und W. Schmid), *Statistics: A Journal of Theoretical and Applied Statistics*, erscheint demnächst.
- GOLOSNOY, V. [2009], “No-transaction bounds and estimation risk,” *Quantitative Finance*, erscheint demnächst.
- GOLOSNOY, V. und R. LIESENFELD [2010], “Interval shrinkage estimators,” *Journal of Applied Statistics*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2007], “Analytical quasi maximum likelihood inference in multivariate volatility models” (mit C.M. Hafner), *Metrika*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2007], “A note on model selection in (time series) regression models – general-to-specific or specific-to-general?”, *Applied Economics Letters*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2007], “Panel nonstationary tests of the Fisher hypothesis in a world wide context” (mit H.-E. Reimers), *International Journal of Applied Econometrics and Quantitative Studies*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2007], “Portfolio performance and the Euro: Prospects for new potential EMU members” (mit R. Haselmann), *Journal of International Money and Finance*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2007], “Testing for random effects in panel models with spatially correlated disturbances”, *Statistica Neerlandica* 61/4, 466-487.

- HERWARTZ, H. [2008], “Exact inference in diagnosing value-at-risk estimates – a Monte Carlo device,” *Economics Letters*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2008], “Testing for causality in variance using multivariate GARCH models” (mit C.M. Hafner), *Annales d’Economie et de Statistique*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2009], “Adaptive forecasting of the EURIBOR swap term structure” (mit O. Blaskowitz), *Journal of Forecasting*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2009], “Development and determinants of systemic risk in European banking – an empirical note” (mit M. Siegel), *Applied Financial Economics Letters* 16, 431-438.
- HERWARTZ, H. [2009], “Modeling stock return dynamics conditional on equilibrium pricing factors – evidence from international equity markets” (mit L. Morales), *European Journal of Finance* 15, 1-29.
- HERWARTZ, H. [2009], “PCA based ex-ante forecasting of swap term structures” (mit O. Blaskowitz), *International Journal of Theoretical and Applied Finance*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2009], “Testing for linear vector autoregressive dynamics under multivariate generalized autoregressive heteroskedasticity” (mit C. Hafner), *Statistica Neerlandica*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2009], “The introduction of the Euro and its effects on investment decisions” (mit R. Haselmann), *Journal of International Money and Finance*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2010], “A comparison of bootstrap and Monte-Carlo testing approaches to value-at-risk diagnosis” (mit I. Waichmann), *Computational Statistics* 25, 725-732.
- HERWARTZ, H. [2010], “A generalized least-squares estimator for cointegration parameters under conditional heteroskedasticity” (mit H. Lütkepohl), *Journal of Time Series Analysis*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2010], “Forecast accuracy and uncertainty in applied econometrics – a recommendation of specific-to-general predictor selection,” *Empirical Economics*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2010], “Growth, unemployment and labor market institutions – evidence from a cross-section of EU regions” (mit A. Niebuhr), *Applied Economics*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2010], “Keep it simple – on specific-to-general predictor selection for time series forecasting in the short, medium and long run,” *Journal of Statistical Computation and Simulation*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2010], “Modeling stock index returns by means of partial least squares methods – an out-of-sample analysis for three stock markets” (mit C. Cengiz), *Applied Stochastic Models in Business and Industry*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2010], “Modeling the Fisher hypothesis: World-wide evidence” (mit



H.-E. Reimers), *Macroeconomic Dynamics*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. [2010], “On economic evaluation of directional forecasts” (mit O. Blaszkowitz), *International Journal of Forecasting*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. [2010], “Regional estimates of the shadow economy in Europe” (mit F. Schneider und E. Tafenau), *International Economic Journal* 24, 627-634.

HERWARTZ, H. [2010], “Specific-to-general predictor selection in approximate autoregressions – Monte Carlo evidence and a large-scale performance assessment with real data, *AStA Advances in Statistical Analysis*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. [2010], “The determinants of health care expenditure – new results from semi-parametric models” (mit Theilen, B.), *Health Economics* 19, 964-978.

HERWARTZ, H. und J. ROESTEL [2009], “Monetary autonomy under floating exchange rates: Evidence based on international break-even inflation rates,” *Studies in Nonlinear Dynamics & Econometrics*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. und F. SIEDENBURG [2007], “Determinants of current account imbalances in 16 OECD countries: an out-of-sample perspective,” *Review of World Economics* 143/2, 349-374.

HERWARTZ, H. und F. SIEDENBURG [2008], “Homogeneous panel unit root tests under cross-sectional dependence – finite sample modifications and the wild bootstrap,” *Computational Statistics and Data Analysis* 53/1.

HERWARTZ, H. und F. SIEDENBURG [2010], “A new approach to unit root testing,” *Computational Economics* 36, 365-384.

HERWARTZ, H. und F. XU [2008], “A functional coefficient model view of the Feldstein-Horioka puzzle,” *Journal of International Money and Finance*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. und F. XU [2008], “A new approach to bootstrap inference in functional coefficient models,” *Computational Statistics & Data Analysis*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. und F. XU [2008], “Panel data model comparison for empirical saving-investment relations,” *Applied Economics Letters*, erscheint demnächst.

HERWARTZ, H. und F. XU [2008], “Reviewing the sustainability/stationarity of current account imbalances with tests for bounded integration,” *The Manchester School* 76/3, 267-278.

JENSEN, U. [2010]: “Estimating German overqualification with stochastic earnings frontiers” (mit H. Gartner und S. Rässler), *AStA Advances in Statistical Analysis* 94, 33-51.

LIESENFELD, R. [2008], “Improving MCMC using efficient importance sampling” (mit J.-F. Richard), *Computational Statistics and Data Analysis* 53, 272-288 .

LIESENFELD, R. [2010], “Bayesian analysis of a Probit panel data model with unobserved individual heterogeneity and autocorrelated errors” (mit M. Burda und J.-F. Richard), *International Journal of Statistics and Management Systems*, erscheint demnächst.

LIESENFELD, R. [2010], “Efficient estimation of probit models with correlated errors” (mit J.-F. Richard), *Journal of Econometrics* 156, 367-376.

- LIESENFELD, R. [2010], “The dynamic invariant multinomial probit model: identification, pretesting and estimation” (mit J.-F. Richard), *Journal of Econometrics* 155, 117-127.
- LIESENFELD, R. [2011], “Dynamic factor models for multivariate count data: an application to stock-market trading activity” (mit R.C. Jung und J.-F. Richard), *Journal of Business and Economic Statistics* 29, 73-85.
- LIESENFELD, R. und G. VALLE MOURA [2010], “Determinants and dynamics of current account reversals – an empirical analysis” (mit J.-F. Richard), *Oxford Bulletin of Economics and Statistics* 72, 486-517.
- TAFENAU, E. [2008], “Gravity equation analysis in the context of international trade: model specification implications in case of the European Union” (mit T. Paas und N.J. Scannell), *Eastern European Economics* 46/5, 92-113.
- XU, F. [2010], “Forecasting annual inflation based on seasonal monthly data” (mit Lütkepohl, H.), *Journal of Time Series Econometrics*, erscheint demnächst.
- XU, F. [2010], “The role of log transformation in forecasting economic variables” (mit Lütkepohl, H.), *Empirical Economics*, erscheint demnächst.

### 2.1.2 Aufsätze in Sammelbänden

- GOLOSNOY, V. [2007], “Sequential monitoring of optimal portfolio weights” (mit W. Schmid und I. Okhrin), in Frisén, M. (Hrsg.), *Financial Surveillance*, Wiley, 179-211.
- GOLOSNOY, V. [2009], “On the application of SPC in finance” (mit I. Okhrin, S. Ragulin und W. Schmid), in Lenz, H.-J., P.-T. Wilrich und W. Schmid (Hrsg.), *Frontiers in Statistical Quality Control* 9, erscheint demnächst.
- GOLOSNOY, V. [2009], “Statistical process control in asset management” (mit W. Schmid), in Härdle, W., N. Hautsch und L. Overbeck (Hrsg.), *Applied Quantitative Finance*, Springer, 2. Aufl., 399-416.
- HERWARTZ, H. [2007], “Conditional heteroskedasticity”, in Lütkepohl, H. und M. Krätzig (Hrsg.), *Applied time series econometrics*, erscheint demnächst.
- HERWARTZ, H. [2007], “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.
- HERWARTZ, H. [2010], “Regional patterns of shadow economy: Modeling issues and evidence from the European Union” (mit F. Schneider und E. Tafenau), in: Schneider, F. (Hrsg.), *Handbook of the Shadow Economy*, Edward Elgar Publishing, erscheint demnächst.
- LIESENFELD, R. [2008], “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, Boston, 419 - 450.

### 2.1.3 Buch-Veröffentlichungen

JENSEN, U. [2010]: “Wozu Mathe in den Wirtschaftswissenschaften?” Vieweg + Teubner.

### 2.1.4 Diskussionspapiere

ASSMANN, C. [2008], “Assessing the effect of current account and currency crises on economic growth,” Economics Working Paper 2008-01.

ASSMANN, C. [2008], “Bayesian approaches to social network estimation and imputation” (mit J. Mumm), Advanced-Eval. Working Paper Series.

ASSMANN, C. [2009], “Costs of housing crises: International evidence” (mit J. Boysen-Hogrefe und N. Jannsen), Kiel Working Paper No. 1524, Institut für Weltwirtschaft, Kiel.

ASSMANN, C. und J. HOGREFE [2009], “Model-based clustering for panel probit models”

ASSMANN, C. und J. HOGREFE [2009], “Reproducing business cycle features in Germany: an evaluation for the need of non-linear models”

GOLOSNOY, V. [2007], “Adaptive model combination for volatility forecasts” (mit Y. Okhrin).

GOLOSNOY, V. [2007], “Mean-variance portfolio problem with transaction costs and estimation risk.”

GOLOSNOY, V. [2009], “Sequential approach to financial market monitoring.”

GOLOSNOY, V. [2009], “Sequential detection of NBER business cycle expansion and recession points” (mit J. Boysen-Hogrefe), Kiel Working Paper Nr. 1528.

GOLOSNOY, V., B. GRIBISCH und R. LIESENFELD [2010], “Conditional autoregressive Wishart model for multivariate stock market volatility.”

GOLOSNOY, V. und H. HERWARTZ [2007], “Semiparametric approach to the prediction of conditional correlation matrices in finance,” Universität Kiel, Economics Working Paper 2007-23.

GRIBISCH, B. und R. LIESENFELD [2010], “Multivariate Wishart stochastic volatility models.”

HERWARTZ, H. [2007], “A robust bootstrap approach to the Hausman test in stationary panel data models” (mit M.H. Neumann), Economics Working Paper 2007-29.

HERWARTZ, H. [2008], “A note on the model selection risk for ANOVA based adaptive forecasting of the EURIBOR swap term structure” (mit O. Blaskowitz), SFB 649 Discussion Paper 2008-64, Humboldt-Universität, Berlin.

HERWARTZ, H. [2008], “Testing for the economic value of directional forecasts in the presence of serial correlation” (mit O. Blaskowitz), SFB 649 Discussion Paper 2008-73, Humboldt-Universität, Berlin.

HERWARTZ, H. [2008], “When, how fast and by how much do trade costs change in the Euro area” (mit H. Weber), Economics Working Paper 2008-17.

HERWARTZ, H. und J. ROESTEL [2010], “Are small economies able to set their own interest rates? Assesing the implications of the macroeconomic trilemma,” EUI ECO 2010/8, European University Institute.

HERWARTZ, H. und F. SIEDENBURG [2009], “The effect of variance breaks on homogeneous panel unit root tests,” Economics Working Paper 2009-7.

HERWARTZ, H. und F. SIEDENBURG [2010], “To converge or not converge: Unit labor cost inflation in the Euro area”

HOGREFE, J. [2007], “Forecasting data revisions of GDP – a mixed frequency approach”

HOGREFE, J. [2007], “Vorhersage von Datenrevisionen des deutschen BSP-Wachstums”

JENSEN, U. [2007]: “The effects of collective bargaining on firm performance: new evidence based on stochastic production frontiers and multiply imputed German establishment data” (mit S. Rässler), IAB-Forschungsbericht 3/2007.

JENSEN, U. [2009]: “Estimating German reservation wages with stochastic wage frontiers” (mit H. Gartner und S. Rässler)

LIESENFELD, R. [2009], “Exploiting non-linearities in GDP growth for forecasting and anticipating turning points” (mit D.N. DeJong, H. Dharmarajan und J.-F. Richard), University of Pittsburgh.

LIESENFELD, R. [2010], “An efficient approach to analyzing state-space representations” (mit D.N. DeJong, H. Dharmarajan und J.-F. Richard), Universität Kiel.

LIESENFELD, R. [2010], “Mixture EIS” (mit T.S. Kleppe und H.J. Skang), Working Paper, University of Bergen.

LIESENFELD, R. und G. VALLE MOURA [2009], “Efficient likelihood evaluation of state-space representations” (mit D. DeJong, H. Dharmarajan und J.-F. Richard), University of Pittsburgh, Working Paper.

PAPE, M. [2009], “More than just one labor market cycle in Germany? An analysis of regional unemployment data” (mit Boysen-Hogrefe, J.)

ROESTEL, J. [2008], “Comovements of breakeven inflation rates under free floating exchange rates”

SIEDENBURG, F. [2008], “The effects of variance breaks on homogeneous panel unit-root tests”

SIEDENBURG, F. [2009], “A new approach to unit root testing”

TAFENAU, E. [2008], “Can welfare be improved by relocating firms? The case of the constructed capital model,” University of Tartu, Working Paper

WALLE, Y.M. [2010]: “Tourist flows and its determinants in Ethiopia,” Ethiopian Development Research Institute, Addis Ababa, Äthiopien, EDRI Working Paper 1/2010

XU, F. [2010], “Testing for unit roots in bounded time series” (mit Cavaliere, G.).

### 2.1.5 Sonstiges

HERWARTZ, H. [2010], “Die volkswirtschaftlichen Kosten der Öl-Havarie im Golf von Mexiko” (mit D. Phaneuf, M. Quaas, K. Rehdanz und T. Requate), *Ökonomenstimme*, 6.9.2010.

HERWARTZ, H. [2010], “Nachlese – die ökonomischen Kosten der Öl-Havarie” (mit D. Phaneuf, M. Quaas, K. Rehdanz und T. Requate), in “Die Ölkatastrophe im Golf von Mexiko – was bleibt?”, Hintergrundinformationen und offene Fragen zu den Folgen der Explosion der Deepwater Horizon für die Meere und ihre Küsten, von Wissenschaftlern aus dem Kieler Exzellenzcluster ‘Ozean der Zukunft’.

JENSEN, U. [2008]: “Fairer Effizienzvergleich oder Milchmädchenrechnung?” (mit J. Oberländer, C. Stiens und P. Wolfram), *Energiewirtschaftliche Tagesfragen* 58/7, 28 - 32.

JENSEN, U. [2008]: “Fairer Effizienzvergleich oder Milchmädchenrechnung?” (mit J. Oberländer, C. Stiens und P. Wolfram), *Zeitschrift für Energie, Markt, Wettbewerb* 3/08, 31 - 35.

JENSEN, U. [2008]: “Studiengebühren: Kurze Haltbarkeit der Regelung,” *Wirtschaftsdienst* 2008/8, 489 - 490.

JENSEN, U. [2008]: “Verfahren mit deutlichen Schranken,” (mit J. Oberländer, C. Stiens und P. Wolfram), *Zeitung für kommunale Wirtschaft* 06/08, 6.

JENSEN, U. [2010]: “Qualitätsregulierung – wie geht es weiter?” (mit P. Wolfram, G. Mener, J. Oberländer, B. Koine, M. Häfner und M. Corr), *EW – das Magazin für die Energiewirtschaft* 109/23-24, 34.

### 2.1.6 Herausgeberschaft

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

Associate Editor der Zeitschrift “Computational Statistics”

## 2.2 Von Institutsmitgliedern gehaltene Vorträge

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

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

*August 2007*: Econometric Society European Meeting, Budapest, Ungarn: “A robust bootstrap approach to the Hausman test in stationary panel data models”

*März 2008*: Norges Bank, Norwegen: “Comovement of breakeven inflation rates under free floating exchange rates”

*August 2008*: Econometric Society European Meeting, Milano, Italien: “Explaining the index skewness via stochastic correlation models”

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

*Januar 2007:* Universität München: “Efficient importance sampling for classical and Bayesian analysis of dynamic latent variable models”

*Juni 2008:* North American Summer Meeting of the Econometric Society, Pittsburgh, USA: “Improving MCMC using efficient importance sampling”

*Juni 2008:* Workshop ‘Emerging Methods in Bayesian Econometrics’, Erasmus-Universität Rotterdam, Niederlande: “Improving MCMC using efficient importance sampling”

*Oktober 2008:* International Conference on Price, Liquidity and Credit Risks, Konstanz: “Dynamic factor models for multivariate count data – an application to stock-market trading activity”

*Februar 2009:* Universität Freiburg: “Dynamic factor models for multivariate count data – an application to stock-market trading activity”

*März 2009:* Ausschuss für Ökonometrie, Verein für Socialpolitik, Marburg: “Dynamic factor models for multivariate count data – an application to stock-market trading activity”

*Juni 2010:* Universität Hannover: “Dynamic factor models for multivariate count data – an application to stock-market trading activity”

*Oktober 2010:* Universität Tübingen: “Efficient estimation of probit models with correlated errors”

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

*August 2007:* Econometric Society European Meeting, Budapest, Ungarn: “Semiparametric approaches to prediction of conditional correlation matrices in finance”

*September 2007:* Statistische Woche, Kiel: “Mean-variance portfolio problem with transaction costs and estimation risk”

*Januar 2008:* Universität Konstanz: “Realized correlations in financial applications”

*August 2008:* Econometric Society European Meeting, Milano, Italien: “Sequential monitoring of portfolio betas”

*September 2008:* Statistische Woche, Köln: “Interval shrinkage for the post-change estimation”

*Oktober 2008:* Universität Bern, Schweiz: “Sequential detection of NBER business cycle expansion and recession points”

*Juni 2009:* C.A.S.E.-Seminar, Humboldt-Universität, Berlin

*Dezember 2009:* Universität Frankfurt (Oder): “Statistical surveillance for volatility forecasting models”

*September 2010:* Statistische Woche, Nürnberg: “The conditional autoregressive Wishart model for multivariate stock market volatility”

### **Prof. Dr. Uwe Jensen**

*September 2007:* Statistische Woche, Kiel: “Der Einfluss von Branchentarifverträgen auf die Produktivität und Effizienz deutscher Betriebe”



*November 2007:* Institut für Agrarökonomie, Kiel: “The effects of collective bargaining on firm performance”

*Juli 2008:* Technische Universität, Dresden: “Ist die Effizienz von Netzbetreibern genau messbar?”

#### **Dr. Christian Aßmann**

*August 2007:* Econometric Society European Meeting, Budapest, Ungarn: “Determinants and costs of current account reversals under heterogeneity and serial correlation”

*September 2007:* Statistische Woche, Kiel: “The decline in German output volatility: a Bayesian analysis”

*Oktober 2007:* Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, München: “Dynamic multi-sector CGE modeling and the specification of capital and a consumption-based pension system”

*August 2008:* Econometric Society European Meeting, Milano, Italien: “Assessing the effect of current account and currency crises on economic growth”

*September 2008:* Statistische Woche, Köln: “Model-based clustering for panel probit models”

#### **Dr. Jens Högrefe**

*August 2007:* Econometric Society European Meeting, Budapest, Ungarn: “The yield spread and GDP growth - time varying leading properties and the role of monetary policy”

*September 2007:* Statistische Woche, Kiel: “Forecasting data revisions of GDP – a mixed frequency approach”

*Oktober 2007:* Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, München: “Forecasting data revisions of GDP - a mixed frequency approach”

*November 2007:* Forschungsseminar, Deutsche Bundesbank, Frankfurt: “Forecasting data revisions of GDP - a mixed frequency approach”

#### **Dr. Florian Siedenburg**

*Juli 2007:* First World Conference of the Spatial Econometrics Association, Cambridge, Großbritannien: “Homogeneous panel unit root tests under cross-sectional dependence: finite sample modifications and the wild bootstrap”

*August 2007:* Econometric Society European Meeting, Budapest, Ungarn: “Homogeneous panel unit root tests under cross-sectional dependence: finite sample modifications and the wild bootstrap”

*August 2008:* Econometric Society European Meeting, Milano, Italien: “Homogeneous panel unit root tests under a break in innovation variance”

*Juli 2009:* Conference on Panel Data, Bonn: “Homogeneous panel unit-root tests under nonstationary volatility”

### **Dr. Guilherme Valle Moura**

*September 2007:* Statistische Woche, Kiel: “Dynamic panel probit models for current account reversals and their efficient estimation”

*Juni 2008:* 2nd International Workshop on Computational and Financial Econometrics, Neuchâtel, Schweiz: “Dynamic panel probit models for current account reversals and their efficient estimation”

*November 2008:* Latin American and Caribbean Economic Association Conference, Rio de Janeiro, Brasilien: “Dynamic panel probit models for current account reversals and their efficient estimation”

*November 2008:* Latin American Meeting, Econometric Society, Rio de Janeiro, Brasilien: “Efficient likelihood evaluation of nonlinear RBC models”

*Dezember 2008:* Brazilian Economic Association (ANPEC) Conference, Salvador de Bahia, Brasilien: “Dynamic panel probit models for current account reversals and their efficient estimation”

*Dezember 2008:* Brazilian Econometric Society Meeting, Salvador de Bahia, Brasilien: “Efficient likelihood evaluation of nonlinear RBC models”

*August 2009:* Econometric Society European Meeting, Barcelona, Spanien: “Efficient likelihood evaluation of state-space representations”

### **Dr. Fang Xu**

*August 2007:* CEMAPRE: Conference on Advances in Semiparametric Methods and Applications, Lissabon, Portugal: “A new approach to bootstrap inference in functional coefficient models”

*August 2007:* Econometric Society European Meeting, Budapest, Ungarn: “A new approach to bootstrap inference in functional coefficient models”

*September 2007:* Statistische Woche, Kiel: “A new approach to bootstrap inference in functional coefficient models”

*März 2008:* Universität Maastricht, Niederlande: “A functional coefficient model view of the Feldstein-Horioka puzzle”

*August 2008:* Econometric Society European Meeting, Milano, Italien: “A functional coefficient model view of the Feldstein-Horioka puzzle”

*November 2008:* Econometrics Research Workshop, European University Institute, Firenze, Italien: “Testing for a unit root in bounded time series”

*April 2009:* London School of Economics and Political Science, London, England: “Testing for unit roots in bounded time series”

*August 2009:* Econometric Society European Meeting, Barcelona, Spanien: “Testing for unit roots in bounded time series”

*Juni 2010:* MWP Conference, Firenze, Italien: “State space model of the housing price to rent ratio”



*Oktober 2010:* Econometric Lunch Seminar, Department of Economics, University of Pennsylvania, USA: “Testing for a unit root in bounded time series”

*November 2010:* Brown Bag Seminar, Department of Finance, The Wharton School, University of Pennsylvania, USA: “State space model of the housing price to rent ratio”

### **Dipl.-Volksw. Bastian Gribisch**

*März 2010:* DAGStat2010, Dortmund: “Multivariate Wishart stochastic volatility models”

*September 2010:* Jahrestagung, Verein für Socialpolitik, Kiel: “The conditional autoregressive Wishart model for multivariate stock market volatility”

*September 2010:* Statistische Woche, Nürnberg: “Multivariate Wishart stochastic volatility models”

*Dezember 2010:* 3rd International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics (ERCIM10), London, Großbritannien: “The conditional autoregressive Wishart model for multivariate stock market volatility”

### **Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann**

*Juni 2009:* Nachwuchsworkshop der Deutschen Statistischen Gesellschaft, Merseburg: “The role of monetary aggregates for inflation forecasting in OECD countries”

*November 2009:* 5th Nordic Econometric Meeting, Lund, Schweden: “Did the introduction of the Euro impact on inflation uncertainty? – an empirical assessment”

*Dezember 2009:* Macroeconometric Workshop, Berlin: “Did the introduction of the Euro impact on inflation uncertainty? – an empirical assessment”

*März 2010:* DAGStat, Dortmund: “Friedman-Ball versus Cukierman-Meltzer: A cross-sectional empirical investigation on the nature of inflation uncertainty”

*Juni 2010:* Konferenz ‘Messung der Preise’, Kiel: “Friedman-Ball versus Cukierman-Meltzer – a cross-sectional empirical investigation on the nature of inflation uncertainty”

*Dezember 2010:* Macroeconometric Workshop, Berlin: “Implications of inflation as a trigger of price adjustment for economic theory and monetary policy”

### **Dipl.-Volksw. Markus Pape**

*Oktober 2009:* 6.IWH/IAB-Workshop zur Arbeitsmarktpolitik, Halle (Saale): “Does Germany have different labor market cycles? An analysis of regional unemployment data”

### **Dipl.-Volksw. Jan Roestel**

*Juni 2010:* Konferenz ‘Messung der Preise’, Kiel: “Are small economies able to set their own interest rates? Assessing the implications of the macroeconomic trilemma”

*November 2010:* Macroeconomic Workshop, DIW, Berlin: “Are small economies able to set their own interest rates?”

### **Dipl.-Volksw. Christoph Strumann**

*Juni 2009:* 15. Nachwuchsworkshop der Deutschen Statistischen Gesellschaft, Merseburg: “Spatial interdependencies of hospital efficiency”

*Juli 2009:* 3rd World Conference of the Spatial Econometrics Association, Barcelona, Spanien: “Exact inference for the spatial autocorrelation coefficient in linear panel models”

*April 2010:* 15th Spring Meeting of Young Economists, Luxembourg: “Spatial interdependence of hospital efficiency in Germany”

*September 2010:* Jahrestagung, Verein für Socialpolitik, Kiel: “Spatial interdependence of hospital efficiency in Germany”

### **Egle Tafenau, M.A.**

*Juli 2008:* Summer Conference, Regional Science Association, Kiel: “Can welfare be improved by relocating firms?”

*Januar 2009:* Annual Conference, Estonian Economic Association, Toila, Estland: “Shadow economy in the EU NUTS-2 regions”

## **2.3 Preise und Auszeichnungen**

### **Dr. Christian Aßmann**

*2008:* Vortragsprämie, Verein für Socialpolitik

### **Dr. Florian Siedenburg**

*2008:* Vortragsprämie, Verein für Socialpolitik

### **Dr. Guilherme Valle Moura**

*2010:* Erich-Schneider-Preis, Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliche Fakultät, CAU

### **Dr. Fang Xu**

*2008:* Fakultätspreis, Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliche Fakultät, CAU: beste Promotion

## **2.4 Forschungsaufenthalte**

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

*April 2009:* Research Fellow, Directorate, General for Economic and Financial Affairs, EU-Kommission, Bruxelles, Belgien

*September 2009 - März 2010:* Fernand Braudel Fellow, European University Institute (EUI), Firenze, Italien.

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

*April - September 2007:* University of Pittsburgh, USA

*August 2009:* University of Pittsburgh, USA

*März 2010:* Universität Erfurt

*August 2010:* University of Pittsburgh, USA

**Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

*Oktober 2008:* Universität Bern, Schweiz

*Januar 2009:* Universität Frankfurt/Oder

**Prof. Dr. Uwe Jensen**

*Januar 2008:* Rheinische Netzgesellschaft, Köln

*April 2008:* N-ERGIE Netz-GmbH, Nürnberg

**Dr. Guilherme Valle Moura**

*Februar 2008:* University of Pittsburgh, USA

**Dr. Fang Xu**

*September 2008 - August 2010:* Max Weber Fellow, European University Institute, Firenze, Italien

*September 2010 - Januar 2011:* The Wharton Financial Institution Center, University of Pennsylvania, USA

## **2.5 Extern finanzierte Forschungsprojekte**

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

*2009-2011:* Förderung des Projekts “Ursachen und Effekte zeitabhängiger Inflationsunsicherheit – Messung, Evidenz und wirtschaftspolitische Implikationen” (mit Prof. Dr. Kai Carstensen, LMU und Ifo-Institut, München) durch die Deutsche Forschungsgemeinschaft

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

*2006-2009:* Förderung des Projekts “Lineare und nichtlineare Panelmodelle mit verallgemeinerter Fehlertermstruktur und ihre Anwendung bei der Analyse von Leistungsbilanzsalden” durch die Deutsche Forschungsgemeinschaft

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

*2006-2009:* Teilnahme am EU-Forschungsprojekt (Projektkoordination Prof. Dr. Dr. C. Henning, Agrar- und Ernährungswissenschaftliche Fakultät, Universität Kiel): “Development and application of advanced quantitative methods to ex-ante and ex-post evaluations of rural development programmes in the EU”

**Prof. Dr. Uwe Jensen**

*2006-08:* Förderung des IAB-Projekts “Schätzung von Akzeptanzlöhnen mittels mehrfach ergänzter Lohndaten aus der IAB-Beschäftigtenstichprobe und Einkommensfrontierfunktionen” durch die Bundesagentur für Arbeit

2007-10: Finanzierung des Projekts “Anreizregulierung” durch die 8KU (8 deutsche Stromnetzbetreiber)

### **Dr. Fang Xu**

2008-2011: Förderung des Projekts “Theoretische und empirische Untersuchungen globaler Ungleichgewichte der Leistungsbilanz” durch die Fritz-Thyssen-Stiftung

## **2.6 Aufenthalte von Gastwissenschaftlern**

*April - Juli 2007:* Yabibal Muluaem Walle, Äthiopien

*Februar 2009:* D.N. DeJong, University of Pittsburgh, USA

*April - Oktober 2009:* Burcu Berke, Antalya, Türkei

*Juli 2009:* B. Theilen, Universitat Rovira i Virgili, Tarragona, Spanien

*seit Oktober 2009:* Yabibal Muluaem Walle, Äthiopien

## **2.7 Am Institut betreute wissenschaftliche Arbeiten**

### **2.7.1 Dissertationen**

#### **Erstgutachten**

Christian Aßmann: “An empirical analysis of current account data” (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Jonas Dovern: “Formation and dispersion of expectations: An empirical analysis with special focus on inflation” (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Jens Hogrefe: “Aspekte der Konjunkturprognose” (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Leonardo Morales-Arias: “International asset prices: Empirical evidence” (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Florian Siedenburg: “Unit root testing in panel and time series models: New tests and economic applications” (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Guillerme Valle Moura: “Efficient importance sampling in applied econometrics,” (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Fang Xu: “A functional coefficient model view of the saving-investment relation” (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

#### **Zweitgutachten**

Gunter Bahr: “Sustainability – is it contagious?” 2009 (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Albrecht Bläsi: “Lerneffekte mit Spillover – Optimale Regulierung, Marktevolution und empirische Evidenz,” 2007 (Gutachter: Prof. Dr. H. Herwartz)

Christina Boll: “Lohneinbußen von Frauen durch geburtsbedingte Erwerbsunterbrechungen,” 2010 (Gutachter: Prof. Dr. Uwe Jensen)

Marcel Büther: “Reducing mixed-integer to zero-one programs,” 2008 (Gutachter: Prof. Dr. Uwe Jensen)

Martin Burda: “Essays in semiparametric econometrics and panel data analysis,” 2007 (University of Pittsburgh, USA, Mitglied des Doctoral Committee: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Hariharan Dharmarajan: “Essays on estimation of non-linear state-space models,” 2008 (University of Pittsburgh, USA, Mitglied des Doctoral Committee: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Lars Edler: “Analysing economic data with self-organizing maps: a geometric neural network approach,” 2007 (Gutachter: Prof. Dr. Uwe Jensen)

Christian Kascha: “Essays in Empirical Macroeconomy,” 2007 (Europäische Universität, Firenze, Italien, Mitglied des Ph.D. Committee: Prof. Dr. H. Herwartz)

Hwa-Taek Lee: “The Markov switching multi-fractal model of asset returns: estimation and forecasting of dynamic volatility with multinomial specifications,” 2007 (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Ruipeng Liu: “Multivariate multi-fractal models: estimation of parameters and applications to risk management,” 2007 (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Iryna Okhrin: 2010 (Europa-Universität Viadrina, Frankfurt/Oder, Gutachter: Prof. Dr. V. Golosnoy)

Serda Selin Ozturk: “Application of efficient importance sampling to stochastic volatility models,” 2009 (University of Pittsburgh, USA, Mitglied des Doctoral Committee: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Siok Kun Sek: “Economic structures, the nature of shocks and the role of exchange rates in the monetary policy formation in the emerging countries of East-Asia,” 2010 (Gutachter: Prof. Dr. V. Golosnoy)

Tore Selland Kleppe: “Integrating out the unknown – four papers on likelihood estimation in non-Gaussian latent variable models,” 2010 (University of Bergen, Norwegen, Mitglied des Doctoral Committee: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Timur Yusupov: “Efficient market hypothesis: through the eyes of artificial technical analysis,” 2007 (Gutachter: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

### **2.7.2 Diplomarbeiten**

Behzet Cengiz: “Predicting share price indices using the partial least squares approach,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Manuel Drenkmann: “Combining volatility forecasts and diagnosing value-at-risk estimates,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Benjamin Engelstätter: “Schätzung der europäischen Geldnachfragefunktion unter Berücksichtigung einer nichtlinearen Gleichgewichtsanpassung,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Hoi Fung: “Schätzung der Liquiditätsprämie indexierter Anleihen,” 2008 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Britta Gehrke: “Modeling and forecasting the long- and short-term component of stock market volatility,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Bastian Gribisch: “Bayesian analysis of bivariate stochastic volatility models,” 2008 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Klaus Grobys: “Volatility response of investment funds to shocks in the underlying stock market - an empirical volatility impulse response (VIR) analysis,” 2008 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Axel Groß-Klußmann: “Analysis of Fed and ECB policy reaction functions,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Marc Hansen: “Der Marktpreis pro Einheit Risiko als stochastischer, zeitabhängiger Prozess im CAPM,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Martina Helms: “Estimating, forecasting and testing within the single-index model,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. V. Golosnoy)

Lars Holtz: “Frontieranalyse bei fehlenden Variablen, Multikollinearität, Hebelpunkten, Heterogenität und Inkonsistenz,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Anna-Katharina Jann: “Sektorale Unterschiede in der deutschen Ausbildungsinadäquanz,” 2008 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Jenny Kastens: “Wie wichtig ist Risikobereitschaft für den Erfolg im Beruf? Eine geschlechtsspezifische Analyse von Einkommen, Erwerbsbeteiligung und Zufriedenheit im Job,” 2008 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Alena Klachkova: “Lohneffekte der Immigration in Deutschland,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Katharina Lima de Miranda: “Portfolio optimization with LASSO statistical technique,” 2009 (Betreuer: Prof. Dr. V. Golosnoy)

Tatiana Mochalova: “Dynamic panel approach for modeling income inequality in OECD countries,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. V. Golosnoy)

Sven Offick: “Bayesianische Schätzung von dynamischen Faktormodellen,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Markus Pape: “Regional patterns of labor market dynamics: a factor model approach,” 2009 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Björn Paulsen: “Multinomiale Mehrperioden-Probit-Modelle – empirische Analyse von Wechselkursregimen,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Marcus Pawel: “Imputation of incomplete credit scoring data” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Malte Rengel: “Particle Markov-Chain Monte Carlo methods: an application to stochastic volatility models” (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Anja Rohwer: “Eine Prognose der mittleren Frist für die Entwicklung des BIP der USA

anhand eines Vector-Error-Correction-Modells,” 2008 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Bettina Scherg: “Auswertung eines Online-Fragebogens zum Thema Intergenerationelle Bildungsniveauübertragung,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Mawuli Konami Segnon: “Specification of random coefficients in panel probit models,” 2010 (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Ulrich Stolzenburg: “Die Anwendung funktionaler Spezifikationen in empirischen Modellen zur Wachstumstheorie,” 2007 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Hanna Stremme: “Testen der Nullhypothese der Unabhängigkeit anhand von impliziten Quantil-Übergangshäufigkeiten,” 2009 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Johannes Strenger: “Regime switching models in financial applications,” 2009 (Betreuer: Prof. Dr. V. Golosnoy)

Christoph Strumann: “Spatial interdependencies of hospital performance,” 2009 (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Clive Noel Werdt: “Testing for indirect causality in a trivariate VAR” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

### **2.7.3 Bachelorarbeiten**

Enno Meiners: “Interaktionseffekte in der intergenerationalen Bildungsniveauübertragung” (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

## **2.8 Laufende Dissertationsprojekte**

Matthias Deschryvere: “High growth firms and employment” (Betreuer: Prof. Dr. U. Jensen)

Bastian Gribisch: “Multivariate volatility models” (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Matthias Hartmann: “Estimation, inference and forecasting procedures for heterogeneous time-series” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Markus Pape: “Bayesian analysis of dynamic factor models for the German labor market” (Betreuer: Prof. Dr. R. Liesenfeld)

Malte Rengel: “Modeling and evaluating time varying inflation uncertainty” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Jan Roestel: “Real and nominal uncertainty effects on financial markets” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Christoph Strumann: “Inference for spatially correlated data and their application to health economics” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)

Yabibal Muluaem Walle: “Financial development in Sub-Saharan Africa – its impacts on capital accumulation, efficiency and economic growth and its determinants” (Betreuer: Prof. Dr. H. Herwartz)



## 2.9 Statistisch-ökonomisches Seminar

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

### 2.9.1 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?”

### 2.9.2 Sommersemester 2007

M.Sc. Yabibal Mulualem Walle (Äthiopien): “A research proposal on financial development and economic growth in Sub-Saharan Africa: a panel data approach”

Prof. Dr. C. Hafner (CORE, Université Catholique de Louvain, Belgien): “Nonstationary factor models”



Dipl.-Kfm. O. Blaskowitz (Humboldt-Universität, Berlin): “Adaptive forecasting of the Euribor swap term structure: an empirical approach”

Dr. Christian Schumacher (Deutsche Bundesbank, Frankfurt): “Real-time forecasting of GDP based on a large factor model with monthly and quarterly data”

M.Sc. Israel Waichmann (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “Personality effect in oligopoly experiments: What can we add to the trait-situation debate?”

Dipl.-Volksw. Jens Hogrefe (ISÖ): “Nicht-lineare Konjunkturmodelle: Anwendung auf deutsche Daten”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Dynamic and conditional features of ex-ante real interest rates”

PD Dr. Y. Okhrin (Europa-Universität, Frankfurt/Oder): “Determining the structure of hierarchical Archimedean copulas”

Dipl. Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Assessing the effect of current account and currency crises on economic growth over time”

MA Guilherme Valle Moura (ISÖ): “Dynamic panel Probit models for current account reversals and their efficient estimation”

Dipl.-Volksw. Florian Siedenburg (ISÖ): “Global imbalances and the housing market: an SVAR approach for the case of the US”

Prof. Dr. Uwe Blien (IAB, Nürnberg): “Phillips curve or wage curve? Evidence from West Germany: 1980-2004”

M.Sc. Yabibal Muluaalem Walle (Äthiopien): “Financial development and economic growth in Sub-Saharan Africa: a panel data approach”

### **2.9.3 Wintersemester 2007/08**

M.A. Valeri Voev (Universität Konstanz): “Estimating high-frequency based (co-)variances: a unified approach”

Prof. Dr. Subal Kumbhakar (State University, New York): “Joint estimation of technology choice and technical efficiency: an application to organic and conventional dairy farming”

Uwe Latacz-Lohmann (Institut für Agrarökonomie, CAU): “Measurement of technical efficiency under simultaneous consideration of input and output dimensions”

Uwe Jensen (ISÖ): “The effects of collective bargaining on firm performance”

Arne Henningsen (Institut für Agrarpolitik, CAU): “Estimation of quasi-concave production frontiers with a simple two-step procedure”

Dr. Jan Mutl (Universität Frankfurt): “Consistent estimation of global VAR models”

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Adaptive forecast combination”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Specification and estimation of heterogeneity in (multinomial) multiperiod probit models: an application to exchange rate data”

Prof. Dr. Christian Pigorsch (Universität Bonn): “A multivariate generalization of the Ornstein-Uhlenbeck stochastic volatility model”

M.A. Guilherme Valle Moura (ISÖ): “Efficient likelihood evaluation of nonlinear and nontrivial DSGE Models”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Linkages among international breakeven inflation rates – the role of exchange rate stability”

Prof. Dr. Martin Missong (Universität Bremen): “Institutionelle Rahmenbedingungen der Geldpolitik: Können Banken Krisen verhindert werden?”

Prof. Dr. Gerd Ronning (Universität Tübingen): “Mess- und Klassifikationsfehler in der Mikroökonomie”

Prof. S. Mittnik, Ph.D. (Universität München): “The volatility of realized volatility”

Prof. Dr. Kai Carstensen (CESifo, München): “Das Kernwachstum der Geldmenge als Inflationsprädiktor”

#### **2.9.4 Sommersemester 2008**

Che-Lin Su, Ph.D. (Northwestern University): “Constrained optimization approaches to estimation of structural models”

Dipl.-Volksw. Florian Siedenburg (ISÖ): “Panel unit root tests under nonstationary volatility”

M.A. Guilherme Valle Moura (ISÖ): “Efficient likelihood evaluation of nonlinear RBC models”

Dr. Taras Bodnar (Europa-Universität Viadrina, Frankfurt/Oder): “Econometrical analysis of the sample efficient frontier”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Diversification benefits of TIPs in different states of inflation uncertainty”

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Adaptive forecast combination”

Dipl.-Volksw. Christian Aßmann (ISÖ): “Model-based clustering of panel probit and factor models”

#### **2.9.5 Wintersemester 2008/09**

M.A. Israel Waichman (Institut für Volkswirtschaftslehre, CAU): “A natural field experiment”

Dipl.-Volksw. Bastian Gribisch (ISÖ): “Bayesian analysis of bivariate stochastic volatility models”

Dr. Victor Winschel (Universität Mannheim): “Breaking the curse of dimensionality in nonlinear state space filters”

M.A. Guilherme Valle Moura (ISÖ): “Estimating inflation models with stochastic volatility”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Asset allocation under real and nominal uncertainty in the presence of treasury inflation indexed securities”

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Von Kurven und Säulen – Inflationsprognosen für OECD-Länder”

Prof. Dr. Ostap Okhrin (Humboldt-Universität, Berlin): “Valuation of collateralized debt obligations”

M.A. Egle Tafenau (ISÖ): “Shadow economy in the EU NUTS 2 regions”

Dipl.-Volksw. Florian Siedenburg (ISÖ): “A new approach to unit root testing”

### **2.9.6 Sommersemester 2009**

Dipl.-Volksw. Marie Waller (Universität Freiburg): “Bayesian estimates of the effects of training incidence and length on labor market transition rates”

M.Sc. Tae Seok Jang (Universität Kiel): “Validation on herding dynamics: adaptive belief system and a noise trader model”

Dipl.-Volksw. Christoph Strumann (ISÖ): “Spatial interdependencies of hospital performance”

Dipl.-Volksw. Markus Pape (ISÖ): “Comparison of different criteria for the determination of the number of factors in approximate factor models”

Dr. Christian Kascha (Norges Bank): “Bootstrapping the likelihood ratio cointegration test in error correction models with unknown lag order”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Monetary autonomy under free floating exchange rates”

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Did the introduction of the Euro impact on inflation uncertainty? An empirical assessment”

Dipl.-Volksw. Bastian Gribisch (ISÖ): “Fat tails in a Wishart multivariate stochastic volatility framework”

### **2.9.7 Wintersemester 2009/10**

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Are small economies able to set their own interest rates? A panel functional coefficient approach to the macroeconomic trilemma”

Dr. Björn Christensen (Meteolytix GmbH, Kiel): “Absatzprognosen unter Berücksichtigung von Wettereinflüssen – Anwendungsfelder und Herausforderungen in der Praxis”

Dr. Jens Boysen-Hogrefe (IfW, Kiel): “Von Rezessionen und ’bösen’ Rezessionen - ein Panelmodell zur Heterogenität von Aufholprozessen nach BIP-Rückgängen”

Dipl.-Volksw. Christoph Strumann (ISÖ): “Hospital performance and spatial interdependence in Germany”

Dipl.-Volksw. Markus Pape (ISÖ): “Dynamic factor models for unemployment data”

Dipl.-Volksw. Florian Siedenburg (ISÖ): “Konvergenz von Lohnstückkosten in der EWU: Endliche Querschnittsdimension, kontemporäre Korrelation und Varianzbrüche”

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Kausalität zwischen Inflation und Inflationsunsicherheit”

Dipl.-Volksw. Bastian Gribisch (ISÖ): “Multivariate Wishart stochastic volatility models”

### **2.9.8 Sommersemester 2010**

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Jackknife forecast combination”

M.Sc. Yabibal M. Walle (ISÖ): “Financial development and economic growth in Sub-Saharan Africa”

Dipl.-Volksw. Christoph Strumann (ISÖ): “Hospital efficiency and the introduction of DRG payments – a spatial semi-parametric approach”

Prof. Dr. Annkatrin Niebuhr (IAB und CAU): “Effekte von Zeitarbeit an der zweiten Schwelle vom Ausbildungs- zum Arbeitsmarkt”

Dipl.-Volksw. Markus Pape (ISÖ): “A dynamic multi-factor model with application”

Dipl.-Volksw. Bastian Gribisch (ISÖ): “Conditional autoregressive Wishart models for stock market volatility”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “Convergence of real capital market interest rates”

### **2.9.9 Wintersemester 2010/11**

Alexander Brian Matthies (CAU): “Applying PCA methods in term structure forecasts”

Prof. Dr. Philipp Sibbertsen (Universität Hannover): “Identification problems in ESTAR models and a new model”

Dipl.-Volksw. Christoph Strumann (ISÖ): “Implementation and performance of Hodges-Lehmann estimators in static panel models with spatially correlated disturbances”

Dr. Silika Prohl (Swiss Banking Institute): “Subsampling weakly dependent time series and application to extremes”

Dr. Oliver Blaskowitz (Humboldt-Universität Berlin): “A note on current aspects in high-frequency trading”

Dipl.-Volksw. Jan Roestel (ISÖ): “A general assessment of the interaction between inflation uncertainty and output uncertainty and its effects on output growth”

Dipl.-Volksw. Markus Pape (ISÖ): “Bayesian factor models and the rotation issue”

M.Sc. Yabibal Walle (ISÖ): “What affects the finance-growth nexus in Sub-Saharan Africa?”

Prof. Dr. Oleg Badunenko (Universität Köln): “Nonparametric stochastic or stochastic nonparametric?”

Dipl.-Volksw. Bastian Gribisch (ISÖ): “The conditional autoregressive Wishart model: Analysing spillover effects and contagion in stock market volatilities”

Dipl.-Volksw. Matthias Hartmann (ISÖ): “Causality between inflation and inflation uncertainty”

## 3 Lehre

### 3.1 Lehrveranstaltungen

In der letzten Spalte finden Sie jeweils die Semesterwochenstunden.

#### 3.1.1 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	Mikroökometrie	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

### 3.1.2 Sommersemester 2007

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
Jensen	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Aßmann	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Jensen	Multivariate Methods (KISS, PHD)	V/UE	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Xu	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Roestel	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Xu	Ökonometrische Software II	V/UE	2
Herwartz	Applied Time Series Analysis (KISS)	V/UE	2
Herwartz	Ökonometrisches Seminar	S	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Analysis	UE	2
Jensen	Lineare Algebra	UE	2
Jensen	Vorkurs	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	1
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	2

### 3.1.3 Wintersemester 2007/08

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	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie I	V	4
Roestel	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Hartmann			
Xu	Ökonometrische Software	UE	2
Herwartz			
Xu	Blockseminar Ökonometrie	S	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler I, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. I, in 9 Gruppen	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 Sommersemester 2008

#### Statistik

Golosnoy	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Hogrefe	Übung zur Methodenlehre der Statistik I, in 11 Gruppen	UE	2
Aßmann	Statistik mit Excel	V/UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Aßmann	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Liesenfeld	A practical course in empirical economics (KiSS)	V/UE	2
Liesenfeld	Simulation-based inference (KiSS)	V/UE	2
Jensen	Multivariate Methods (KISS, PHD)	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2

#### Ökonometrie

Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Roestel	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Hartmann	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Hartmann	Ökonometrische Software II	V/UE	2

#### Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler

Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler II, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. II, in 12 Gruppen	UE	2

#### Wirtschaftsinformatik

Mengel	Einführung in MATLAB	V/UE	1
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	1
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	2



### 3.1.5 Wintersemester 2008/09

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Gribisch	Übung zur Methodenlehre der Statistik II, in 9 Gruppen	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	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie I	V	4
Hartmann	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Strumann	Computerübung zur Ökonometrie I	UE	2
Roestel	Ökonometrische Software	UE	2
Herwartz	Projektseminar Ökonometrie	S	2
Golosnoy	Applied Time Series Analysis	V/UE	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Tafenau	Econometrical Preparatory Course (PHD)	UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler I, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. I, in 11 Gruppen	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel			
Raters	Computergestützte Datenanalyse, in 2 Gruppen	UE	2

### 3.1.6 Sommersemester 2009

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Pape	Übung zur Methodenlehre der Statistik I, in 10 Gruppen	UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene I	V	4
Gribisch	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene I	UE	2
Liesenfeld	A practical course in empirical economics (KiSS)	V/UE	2
Liesenfeld	Simulation-based inference (KiSS)	V/UE	2
Jensen	Multivariate Methods (PHD)	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Ökonometrie II	V	4
Hartmann	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Roestel	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	1
Herwartz	Econometrics for Financial Market Data	V	2
Strumann	Ökonometrische Software II	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler II, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. II, in 11 Gruppen	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	3
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	1

### 3.1.7 Wintersemester 2009/10

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Pape	Übung zur Methodenlehre der Statistik II, in 7 Gruppen	UE	2
Liesenfeld	Statistik für Fortgeschrittene II	V	4
Gribisch	Übung zur Statistik für Fortgeschrittene II	UE	2
Liesenfeld	Mikroökonomie	V/UE	2
Liesenfeld	Statistics for Financial Markets	V/UE	2
Golosnoy	Statistical Methods for Portfolio Selection	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Boysen-Hogrefe	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Roestel			
Strumann	Übung zur Einführung in die Ökonometrie, in 4 Gruppen	UE	2
Siedenburg	Computerübung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Jensen	Empirische Wirtschaftsforschung	V	2
Boysen-Hogrefe	Ökonometrie I	V	4
Hartmann	Übung zur Ökonometrie I	UE	2
Siedenburg	Computerübung zur Ökonometrie I	UE	2
Jensen	Labor Econometrics (PHD)	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler I, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. I, in 13 Gruppen	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel			
Raters	Computergestützte Datenanalyse, in 3 Gruppen	UE	2

### 3.1.8 Sommersemester 2010

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik I	V	4
Pape	Übung zur Methodenlehre der Statistik I, in 11 Gruppen	UE	2
Gribisch			
Pape	Statistik für Fortgeschrittene, Klausurvorbereitungskurs	UE	2
Liesenfeld	A practical course in empirical economics	V/UE	2
Liesenfeld	Mikroökometrie	V/UE	2
Liesenfeld	Simulation-based inference	V/UE	2
Liesenfeld	Statistics for financial markets	V/UE	2
Jensen	Multivariate data analysis (ISOS)	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Boysen-Hogrefe	Ökonometrie II	V	4
Hartmann	Übung zur Ökonometrie II	UE	2
Roestel	Computerübung zur Ökonometrie II	UE	1
Boysen-Hogrefe	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Strumann	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	1
Roestel	Computerübung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	1
Boysen-Hogrefe	Forecasting methods	V	2
Xu	Die Finanzkrise aus ökonometrischer Sicht	V	2
Siedenburg	Ökonometrische Software II	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler II, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. II, in 13 Gruppen	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Übungen zum Programmieren für Wirtschaftswissenschaftler	V/UE	2
Mengel	Fortgeschrittene PASCAL-Programmierung mit DELPHI	V/UE	2

### 3.1.9 Wintersemester 2010/11

Statistik			
Golosnoy	Methodenlehre der Statistik II	V	4
Gribisch	Übung zur Methodenlehre der Statistik II, in 9 Gruppen	UE	2
Liesenfeld	Advanced Statistics I	V	3
Pape	Tutorial Advanced Statistics I	UE	2
Liesenfeld	A practical course in empirical economics	V/UE	2
Liesenfeld	Statistics for Financial Markets	V/UE	2
Liesenfeld	Statistisches Seminar	S	2
Ökonometrie			
Herwartz	Einführung in die Ökonometrie	V	2
Roestel			
Strumann	Übung zur Einführung in die Ökonometrie	UE	2
Jensen	Empirische Wirtschaftsforschung	V	2
Herwartz	Econometrics I	V	3
Hartmann	Tutorial Econometrics I	UE	2
Roestel			
Strumann	Computerübung zu Econometrics I	UE	2
Herwartz	Panel Data Models	V	2
Niebuhr	Spatial Econometrics	V	2
Jensen	Labor Econometrics	V/UE	2
Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler			
Jensen	Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler I, in 2 Gruppen	V	2
Jensen	Übungen zur Mathematik für Wiwi. I, in 15 Gruppen	UE	2
Wirtschaftsinformatik			
Mengel	Computergestützte Datenanalyse, in 3 Gruppen	UE	2

### 3.1.10 Sonstige Lehrveranstaltungen

#### Prof. Dr. Vasyl Golosnoy

*Januar - September 2010:* Lehrstuhlvertretung der W3-Professur "Statistik und Ökonometrie" an der Helmut-Schmidt-Universität Hamburg

#### Prof. Dr. Uwe Jensen

*November 2009:* "Wozu brauchen Wirtschaftswissenschaftler Mathe?" Käthe-Kollwitz-Schule, Kiel

#### Dr. Christian Aßmann

*Dezember 2007:* "Panel data," Ph.D.-Seminar, Technische Universität, Dresden

*Dezember 2008:* “Panel Econometrics,” Seminar im Rahmen des Advanced-Studies-Programms, Institut 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 2008**

Bachelorstudium:

2. Prof. Dr. U. Jensen (Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler II)

### **3.3 Extern finanzierte Lehrprojekte**

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

*2008/09:* Förderung des Projekts “Entwicklung interaktiver Lern- und Lehrmaterialien für das BA-Pflichtmodul Ökonometrie” durch den Innovationsfonds Schleswig Holstein

### **3.4 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:

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

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

Friedrich Wagner (Lehrstuhl für Geld, Währung und Internationale Finanzmärkte): “Introduction to MATLAB in applications to financial markets”

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

#### **Sommersemester 2007**

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

Arthem Korzhenevych (Institut für Regionalforschung): “CGE analysis”

Christian Merkl (Institut für Volkswirtschaftslehre): “Arbeitsmarktökonomik II”

Christian Merkl (Institut für Volkswirtschaftslehre): “Monetary economics”

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

Roland Winkler (Lehrstuhl für Makroökonomik): “Seminar zur dynamischen Makroökonomik”

### **Sommersemester 2008**

Christian Merkl (Institut für Volkswirtschaftslehre): “Dynamic monetary and labor theory”

### **Wintersemester 2008/09**

Sourafel Girma (Doktorandenprogramm 'Quantitative Economics'): “Topics in microeconomics”

## **3.5 Aufenthalte von Gästen**

*März 2007:* Delegation zweier Hochschulen aus Olsztyn, Polen

## 4 Weitere Aktivitäten

### 4.1 Konferenzorganisation

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

- Programmkomitee der Konferenz “Recent Developments in Financial Econometrics” 2009 in Berlin

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld und Prof. Dr. Uwe Jensen**

- Lokale Organisation der Statistischen Woche 2007 in Kiel

### 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
- Annals of Regional Science
- Computational Statistics & Data Analysis
- Econometric Reviews
- Econometrics Journal
- Economics Bulletin
- Empirical Economics
- Energy Economics
- European Journal of Political Economy
- International Journal of Forecasting
- Journal of Applied Econometrics
- Journal of Applied Statistics
- Journal of Econometrics
- Journal of Empirical Finance
- Journal of Health Economics
- Journal of International Money and Finance
- Journal of Money, Credit and Banking
- Journal of Time Series Analysis
- Quantitative Finance
- Studies in Nonlinear Economics and Dynamics
- Weltwirtschaftliches Archiv



**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

- Applied Stochastic Models in Business and Industry
- Computational Statistics
- Computational Statistics & Data Analysis
- Econometrics Reviews
- Economics
- Empirical Economics
- International Economic Review
- Journal of Applied Econometrics
- Journal of Business and Economic Statistics
- Journal of Econometrics
- Journal of Empirical Finance
- Journal of Futures Markets
- Journal of Time Series Analysis
- Quantitative Finance
- Statistical Methods and Applications
- Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics
- The Econometrics Journal
- The Quarterly Review of Economics and Finance

**Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

- Advances in Statistical Analysis
- Computational Statistics and Data Analysis
- Empirica
- European Economic Review
- European Journal of Finance
- Journal of Banking and Finance
- Journal of Economic Behaviour and Organization
- Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics
- Theory and Decision

**Prof. Dr. Uwe Jensen**

- German Economic Review
- Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik
- Journal of Productivity Analysis
- Pearson Addison-Wesley

**Dr. Fang Xu**

- Applied Economics
- Computational Statistics

## 4.2.2 Sonstige Gutachten

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

- Deutsche Forschungsgemeinschaft: Einzelanträge
- Mitarbeit an Berufungslisten anderer Universitäten

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

- Deutsche Forschungsgemeinschaft: Einzelanträge, Graduiertenkollegs
- Gutachten über und Mitarbeit an Berufungslisten anderer Universitäten
- National Science Foundation, Arlington, USA: Einzelanträge
- Research Grants Council, Hong Kong: Einzelanträge

### **Prof. Dr. Uwe Jensen**

- Studienstiftung des Deutschen Volkes: Einzelanträge

## 4.3 Mitgliedschaften

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

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

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

- Deutsche Statistische Gesellschaft
- 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

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

- Deutsche Statistische Gesellschaft
- Econometric Society
- Verein für Socialpolitik

### **Prof. Dr. Uwe Jensen**

- Fachbeirat des Centrums für Hochschulentwicklung
- Deutsche Statistische Gesellschaft
- Econometric Society

- Institute of Mathematical Statistics
- Productivity Analysis Research Network
- Verein für Socialpolitik

**Dr. Fang Xu**

- Deutsche Statistische Gesellschaft
- Econometric Society
- European Economic Association
- Verein für Socialpolitik

## 4.4 Akademische Selbstverwaltung

**Prof. Dr. Helmut Herwartz**

- Stellvertreter im Informationsausschuss des Senats
- Prodekan bis Juni 2007 und von Januar 2009 bis Dezember 2010
- Dekan von Juli 2007 bis Dezember 2008

**Prof. Dr. Roman Liesenfeld**

- Vertreter im Senatsausschuss 'Lektorat Deutsch für Ausländer'
- Stellvertreter im Senatsausschuss für Technologietransfer
- Mitglied des Prüfungsausschusses
- Prüfer für das Kooperationsvermögen der Universität Kiel
- Prodekan seit Dezember 2010

**Prof. Dr. Vasyl Golosnoy**

- Auswahlkommission des Doctoral Programmes 'Quantitative Economics' der Universität Kiel, 2008 und 2010

**Prof. Dr. Uwe Jensen**

- Auswahlkommission des Doctoral Programmes 'Quantitative Economics' der Universität Kiel, 2007
- Studienfachberater für Quantitative Economics, seit 2009
- Stellvertreter im Prüfungsausschuss

## 4.5 Populärwissenschaftliches

**Prof. Dr. Uwe Jensen**

*August 2007:* Vortrag, N-ERGIE Netz-GmbH, Nürnberg: "Stochastische Frontiermodelle"

*November 2007:* Vortrag, 'Night of the Profs', Universität Kiel: "Was macht uns glücklich: Wundervolles Wasser, wundersamer Reichtum oder keines von beiden?"

*November 2007:* Interview, SAT 1 live, 30.11.07, 17.30 Uhr: "Lottofieber"

*Januar 2008:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Trittau: “Welche Uni ist denn nun die beste? Zur Genauigkeit von Hochschulranglisten”

*Mai 2008:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Hohenwestedt: “Macht Geld glücklich? Einkommen und Zufriedenheit”

*März 2009:* Posterstand, Berufsmesse, Käthe-Kollwitz-Schule, Kiel

*April 2009:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Meldorf: “Macht Geld glücklich? Einkommen und Zufriedenheit”

*Januar 2010:* Vortrag, ‘Night of the Profs’, Universität Kiel: “Im Netz verheddert – Probleme bei der Stromnetz-Regulierung”

*Februar 2010:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Niebüll: “Verdienen Sie, was Sie verdienen?”

*März 2010:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Bredstedt: “Macht Geld glücklich? Einkommen und Zufriedenheit”

*September 2010:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Rantum/Sylt: “Macht Geld glücklich? Einkommen und Zufriedenheit”

*November 2010:* Vortrag, Schleswig-Holsteinische Universitätsgesellschaft, Haderslev, Dänemark: “Macht Geld glücklich? Einkommen und Zufriedenheit”