

Doktorandenseminar
“Topics in Time Series Econometrics”

vom 6. bis 7. August 2013 im Haus Tornow am See, Oberbarnim

Organisatoren: Prof. Dr. Dieter Nautz, Freie Universität Berlin
 Prof. Dr. Christian Offermanns, Freie Universität Berlin

Programm:

Dienstag, 6.8.2013:

14:00	Wenjuan Chen (FU Berlin)	The impact of US monetary policy on stock prices: New evidence from the Markov switching volatility VAR models
14:40	Aleksei Netsunajev (FU Berlin)	Identifying Monetary Policy Shocks via Heteroskedasticity: a Bayesian Approach
15:20	Till Strohsal (FU Berlin)	Testing the Preferred-Habitat Theory under Time-Varying Risk Aversion
16:30	Gunda-Alexandra Detmers (FU Berlin)	How Stale Central Bank Interest Rate Projections Affect Interest Rate Uncertainty
17:10	Christian Offermanns (FU Berlin)	On the Degree of Homogeneity in Equilibrium Exchange Rate Adjustment

Mittwoch, 7.8.2013:

09:30	Christopher Boortz (DIW Berlin) Simon Jurkatis (BDPEMS)	How to measure herd behavior
10:10	Anton Velinov (DIW Berlin)	Are there Bubbles in Stock Prices? Testing for Fundamental Shocks
11:20	Tsung-Hsien Michael Lee (BDPEMS)	What accounts for the non-fundamental components in house prices?
12:00	Marlene Karl (DIW Berlin)	Bank Size Heterogeneity and Small Business Finance
14:00	Uwe Hassler (Goethe Universität Frankfurt)	Persistence under Temporal Aggregation and Differencing

Weitere Gäste: Prof. Dr. Helmut Lütkepohl, Freie Universität Berlin
 Prof. Dr. Jürgen Wolters, Freie Universität Berlin
 Dr. Sven Schreiber, (IMK Düsseldorf und FU Berlin)
 Dr. Lars Winkelmann, Freie Universität Berlin

Das Institut für Statistik und Ökonometrie dankt der Deutschen Bundesbank, Hauptverwaltung Berlin recht herzlich für die Unterstützung des Seminars.