

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

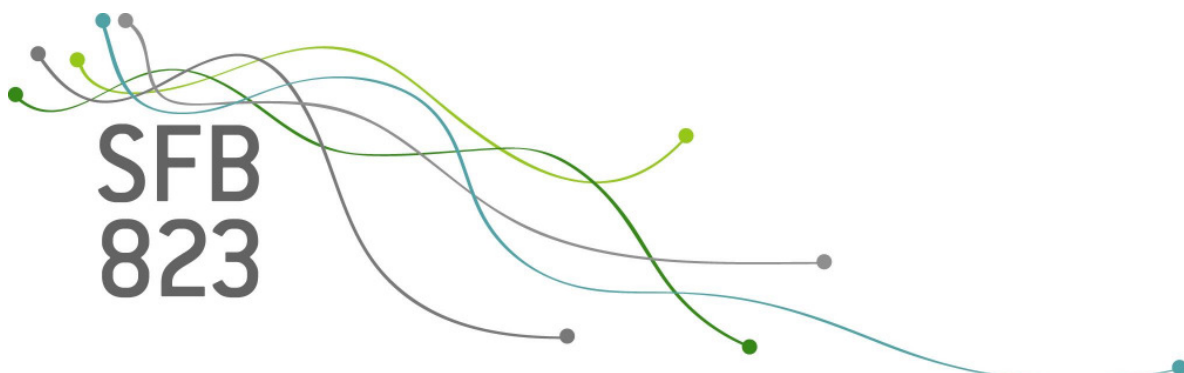
Ausgabe 1

Sprecher: Prof. Dr. Walter Krämer
Geschäftsstelle: Melanie Wübbold
Geschäftsführung: Dr. Thorsten Ziebach

Technische Universität Dortmund
Fakultät Statistik
Institut für Wirtschafts- und Sozialstatistik
D-44221 Dortmund

Telefon: 0231 / 755-3125
Fax: 0231 / 755-5284
e-Post: walterk@statistik.tu-dortmund.de

Info-Brief



Liebe Freunde, Förderer, Projektleiter und Mitarbeiter des Sonderforschungsbereiches 823 "Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse", hiermit übergeben wir Ihnen die erste Folge von Dokumentationen unseres Tuns. Dieses wird vom deutschen Steuerzahler mit jährlich fast zwei Millionen Euro gefördert, da ist es nur recht und billig, dass wir die Finanzierer dieses Unternehmens wissen lassen, was mit diesen Geldern geschieht. Und Kolleginnen und Kollegen, auch interessierte Journalisten sowie Freunde der Statistik in Wirtschaft und Verwaltung wollen wir damit ermutigen, sich unsere Forschungsergebnisse anzusehen und für ihre eigenen Zwecke nutzbar zu machen. Unser Sonderforschungsbereich ist keine l'art pour l'art, er will helfen, praktische Probleme in Wirtschaft und Technik besser zu lösen als das bisher möglich war. Haben Sie also keine Hemmungen, auf unseren Netzseiten zu stöbern, unsere Diskussionspapiere zu kritisieren und wenn Sie wollen, auch mich persönlich anzurufen. Wissenschaft lebt von der Diskussion, und die ist hiermit offiziell eröffnet.

Walter Krämer
TU Dortmund
Sprecher des SFBs

Ehrungen und Preise

Am 27.11.2009 wurde unser Projektleiter **Marc Hallin (C1)** zum Ehrenmitglied der Société Belge de Statistique ernannt. Lieber Marc, ganz herzlichen Glückwunsch von uns allen!

Im Rahmen der FABTECH International & AWS Welding Show, Chicago/Illinois (www.aws.org/expo) erhielt Projektleiter **Wolfgang Tillmann (B1, B4)** den **Robert L. Peaslee Award** für die Veröffentlichung "Characterization of Titanium/Steel Joints Brazed in Vacuum" im Welding Journal, American Welding Society. Auch dazu ganz herzlichen Glückwunsch!

Und gleich zwei unserer studentischen Hilfskräfte bzw. Mitarbeiter wurden als Jahrgangsbeste ihrer jeweiligen Studiengänge ausgezeichnet: **Benjamin Niestroy**, studentische Hilfskraft im Teilprojekt A4, erhielt den Jahrgangsbestenpreis der Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Fakultät an der TU Dortmund für seine Diplomarbeit mit dem Thema "Euler-Gleichungen und Geldmarktzinsen" und **Dominik Wied**, seit August 2009 Mitarbeiter im Projekt A1, wurde als Jahrgangsbester der Fakultät Statistik ausgezeichnet. Und dann hat er auch gleich gezeigt, dass man nicht notwendigerweise für Doktorarbeiten lange Jahre braucht. Am 18. Dezember 2009 absolvierte er die mündliche Doktorprüfung mit Auszeichnung und ist damit der jüngste Doktor in NRW aller Zeiten. Wissenschaftsminister Pinkwart schickte einen Glückwunschbrief. Lieber Herr Wied, bitte weiter so!

Die Doktorarbeit mit dem Titel "Ein Fluktuationstest auf konstante Korrelation" befasst er sich mit einem aktuellen Kapitalmarktphänomen. In Zeiten extremer wirtschaftlicher Abschwünge scheinen die Renditen riskanter Wertpapiere stärker als sonst zu korrelieren. Da Anleger weltweit versuchen, ihr Anlagerisiko durch Streuung zu minimieren, ist es natürlich äußerst wichtig, die Struktur dieser Abhängigkeiten genau zu kennen. Hier setzt die Arbeit von Herrn Wied an, der genau für diese Korrelationen erstmals statistische Testverfahren entwickelt hat.

M. Wendler (C3) hat zum 01.08.2009 ein zweijähriges Promotionsstipendium der Studienstiftung des deutschen Volkes angetreten. Sein Promotionsvorhaben "Empirische U-Quantile für abhängige Daten" ist in das Teilprojekt C3 eingebunden.

Veröffentlichungen

1) Fachzeitschriften

akzeptiert:

F. Balabdaoui, K. Bissantz, N. Bissantz (C4) und H. Holzmann: Demonstrating single- and multiple currents through the E. coli-SecYEG-pore: Testing for the number of modes of noisy observations, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

S. Biedermann, H. Dette (A1, C1, C2) und W. Zhu: Geometric construction of optimal designs for dose-response models with two parameters, erscheint in: *Journal of Statistical Planning and Inference*.

F. Bretz, H. Dette (A1, C1, C2) und J. Pinheiro: Practical considerations for optimal designs in clinical dose finding studies, erscheint in: *Statistics in Medicine*.

A. Bücher (A1) und H. Dette (A1, C1, C2): Some comments on goodness-of-fit tests for the parametric form of the copula based on L₂-distances, erscheint in: *Journal of Multivariate Analysis*.

H. Dette (A1, C1, C2), C. Kiss und W. K. Wong: A web-based tool for finding optimal designs for the Michaelis-Menten model and an overview, erscheint in: *Statistics in Biopharmaceutical Research*.

H. Dette (A1, C1, C2) und M. Marchlewski (C1): A robust test for homoscedasticity in nonparametric regression, erscheint in: *Journal of Nonparametric Statistics*.

H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und A. Pepelyshev: Optimal designs for estimating the slope of a regression, erscheint in: *Statistics*.

H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und A. Pepelyshev: Optimal design for smoothing splines, erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.

H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev, N. Neonenko und A. Zhigljavsky: Asymptotic optimal designs under long-range dependence error structure, erscheint in: *Bernoulli*.

H. Dette (A1, C1, C2) und R. Scheder: Estimation of additive quantile regression, erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*, doi: 10.1007/s10463-009-0225-5).

H. Dette (A1, C1, C2) und R. Scheder: A finite sample comparison of nonparametric estimates of the effective dose in quantal bioassay, erscheint in: *Journal of Statistical Computation and Simulations*, doi: 10.1080/00949650902737465.

H. Dette (A1, C1, C2) und M. Trampisch (C2): A general approach to D-optimal designs for weighted univariate polynomial regression models, erscheint in: *Journal of the Korean Statistical Society*.

M. Hallin (C1), D. Paindaveine und M. Siman: Multivariate quantiles and multiple output regression quantiles: from L1 optimization to halfspace depth (with discussion and rejoinder), erscheint in: *Annals of Statistics*.

M. Hallin (C1), D. Paindaveine und T. Verdebout: Testing for common principal components under heterokurticity, erscheint in: *Journal of Nonparametric Statistics*.

A. Schabert und L. Linnemann (beide A4): Debt Non-neutrality, Policy Interactions, and Macroeconomic Stability, erscheint in: *International Economic Review*.

M. Vetter (A1), J. Jacod und M. Podolskij: Limit theorems for moving averages of discretized processes plus noise, erscheint in: *Annals of Statistics*.

R. Weißbach und R. Walter (beide A1): A Likelihood ratio test for Stationarity of rating transitions, erscheint in: *Journal of Econometrics*. doi: 10.1016/j.jeconom.2009.10.016.

bereits erschienen:

H. Dehling (C3): Andre Dabrowski's work on limit theorems and weak dependence, *The Canadian Journal of Statistics* 37, 2009, 307-326.

H. Dehling (C3), O. Durieu und D. Volny: New techniques for empirical processes of dependent data, *Stochastic Processes and their Applications* 119, 2009, 3699-3718.

H. Dehling (C3), O. Sharipov: Marcinkiewicz-Zygmund Strong laws for U-statistics of weakly dependent observations, *Statistics and Probability Letters* 79, 2009, 2028-2036.

H. Dehling, M. Wendler (beide C3): Central limit theorem and the bootstrap for U-statistics of strongly mixing data, *Journal of Multivariate Analysis* 100, 2010, 126-137.

H. Dette (A1, C1, C2) und G. Wieczorek (C1): Testing for a constant coefficient of variation in nonparametric regression, *Journal of Statistical Theory and Practice* 3 (3), 2009, 587-612.

M. Hörmann und A. Schabert (beide A4): An interest rate peg might be better than you think, *Economics Letters* 105, 2009, 156-158.

A. Messaoud, W. Theis, F. Hering und C. Weihs (B3, B4, C2): Monitoring a Drilling Process Using Residual Control Charts, *Quality Engineering* 21, 2009, 1-9.

A. Messaoud und C. Weihs (B3, B4, C2): Monitoring a deep hole drilling process by nonlinear time series modelling, *Journal of Sound and Vibration* 321, 2009, 620-630.

W. Tillmann (B1, B4), E. Vogli (B1), I. Baumann, G. Kopp und C. Weihs (B3, B4, C2): Desirability-Based Multi-Criteria Optimization of HVOF Spray Experiments to Manufacture Fine Structured Wear-Resistant 75Cr3C2-25(NiCr20) Coatings, *Journal of Thermal Spray Technology*, 2009.

doi: 10.1007/s11666-009-9383-5

M. Vetter (A1): Limit theorems for bipower variation of semimartingales, *Stochastic Processes and their Applications* 120, 2009, 22-38.

2) Sammelbände

M. Hallin (C1): On the non Gaussian asymptotics of the likelihood ratio test statistic for homogeneity of covariance, erscheint in: D. Hunter, D. Richards und J. L. Rosenberger (Hrsg.): Festschrift for Thomas Hettmansperger.

O. Mersmann, H. Trautmann, B. Naujoks und C. Weihs (B3, B4, C2): On the Distribution of EMOA Hypervolumes, akzeptiert bei: *Proceedings of the Learning and Intelligent OptimizatioN (LION) Workshop 2010, LNCS Series, January 18-22, Venice, Italy*.

D. Vogel (C3): On Generalizing Gaussian Graphical Models, in: *Proceedings of the 16th European Young Statisticians Meeting (EYSM)*, Ciomara, R., Badin, L. (Hrsg.), University of Bucharest, Bucharest, 2009, 149-153.

C. Weihs, N. Raabe und O. Webber: Deriving a statistical model for the prediction of spiralling in BTA-deep-hole drilling from a physical model, in: A. Okada, T. Imaizumi, H.-H. Bock, W. Gaul (Hrsg.): *Cooperation in Classification and Data Analysis*; Springer, 2009, 107-114.

C. Weihs (B3, B4, C2) und G. Szepannek (B3): Distances in Classification, in: P. Perner (Hrsg.) *Advances in Data Mining – Applications and Theoretical Aspects*, LNAI 5633; Springer, 2009, 1-12.

3) Sonstiges

F. Jüßen, L. Linnemann und A. Schabert (alle A4): Default risk premia on government bonds in a quantitative macroeconomic model, *Tinbergen Discussion Paper 09-102/2*, 2009.

S. Reynards und A. Schabert (A4): Modelling Monetary Policy, *Tinbergen Discussion Paper 09-094/2*, 2009.

A. Schabert (A4): Monetary Policy under a Fiscal Theory of Sovereign Default, *Tinbergen Discussion Paper 09-093/2*, 2009.

Software

T. Mildenerger (C1), Y. Rozenholc, D. Zasada: R-Package "histogram" zum Discussion Paper 31/09, *The Comprehensive R Archive Network (CRAN)*.

Details unter: <http://cran.r-project.org/>

Vorträge

1) eingeladene Vorträge auf Konferenzen:

R. Fried (C3): On Robust Shift Detection in Time Series, ERCIM Workshop, 29.–31.10.2009, Limassol.

R. Fried (C3): On Robust Change Point Detection, Statistische Woche 2009, 05.–08.10.2009, Wuppertal.

R. Fried (C1): Alarms – The Statistician, World Congress 2009, 06.–10.09.2009, München.

M. Hallin (C1): Dynamic Factor Models: identification, estimation, and blocks, Troisièmes Rencontres des jeunes Statisticiens (Société française de Statistique), Centre Paul Langevin, 31.08.–04.09.2009, Aussois.

M. Hallin (C1): From quantile regression to halfspace depth, Annual Meeting of the Belgian Statistical Society, 15.–16.10.2009, Lommel.

M. Hallin (C1): On Testing for Symmetry in Skew-Symmetric Families, Conference on "Theory and Applications of Statistical Inference in Multivariate and Time Series Models", Kagoshima University, 03.–05.12.2009.

M. Hallin (C1): Market liquidity as dynamic factors, Conference on "Nonlinear Time Series: Threshold Modelling and Beyond" (in celebration of Howell Tong's 65th birthday), Department of Statistics and Actuarial Science, Universität Hongkong, 17.–19.12.2009.

C. Weihs (B3, B4, C2): Control charts based on models derived from differential equations, ENBIS 2009, 20.–24.09.09, Göteborg.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen und Fakultätsseminaren:

M. Birke (C4): Asymptotic confidence bands in inverse regression problems, EMS 2009, 21.07.2009, Toulouse.

M. Borowski (B1): An adaptive repeated median filter for online signal extraction, Statistische Woche 2009, 06.10.2009, Wuppertal.

H. Dehling (C3): Asymptotic Distribution of Empirical U-Quantiles for Dependent Data, Workshop on Limit Theorems, 03.–06.08.2009, Prag.

H. Dette (A1, C1, C2): Convex Sets, Optimal Designs and Pharmacokinetics, Universität Bern, 13.11.2009, Universität Brüssel, 27.11.2009.

M. Hallin (C1): Dynamic factors with block structure, Econometrics Workshop, Department of Economics, University of Columbia, 29.09.2009, Columbia.

M. Hörmann (A4): Macroeconomic Effects of Unconventional Monetary Policy, Banco Central de Chile, 15.11.09, Santiago.

F. Jüßen (A4): Sovereign Risk Premia under a Natural Borrowing Limit, Universität Siegen, 22.07.09.

F. Jüßen (A4): Default Risk Premia on Government Bonds in a Quantitative Macroeconomic Model, Universität Bochum, 01.12.09.

L. Linnemann (A4): Default risk premia on government bonds in a simple business cycle model, Luncheon Research Seminar, Fakultät Wirtschaftswissenschaften, Freie Universität Bozen/Bolzano, 06.10.09.

O. Mersmann (B4): Multicriteria optimization using R and the desirability package desire, ENBIS 2009, 20.-24.09.09, Göteborg.

M. Rieth (A4): Fiscal and Monetary Policy Interaction in Turkey: Evidence from an Estimated DSGE Model, 5th Dynare Conference, Norges Bank, 31.08.-01.09.09, Oslo.

A. Schabert (A4): Modelling Monetary Policy, European Economic Association Annual Conference, 23.-27.08.09, Barcelona.

A. Schabert (A4): Models and Policies for Economies with Credit and Financial Instability, Federal Reserve Bank of Cleveland, 15.10.09, Cleveland.

A. Schabert (A4): Quantitative Easing, Monetary Policy Division Europäische Zentralbank (EZB), 21.07.09, Frankfurt a.M.

A. Schabert (A4): Macroeconomic Effects of Unconventional Monetary Policy, Universität Bonn, 16.11.09.

M. Vetter (A1): Inference for semimartingales observed at high frequency, Stochastisches Kolloquium, Universität Göttingen, 08.07.2009.

M. Vetter (A1): Limit theorems for bipower variation of semimartingales, Workshop 'Statistical Inference for Lévy Processes with Applications to Finance', EURANDOM Eindhoven, 15.07.2009.

M. Vetter (A1): Limit theorems for bipower variation of semimartingales, Workshop 'Financial Mathematics meets Econometrics', Universität Bonn, 30.11.2009.

D. Vogel (C3): Robust Estimation in Gaussian Graphical Models, eingeladener Vortrag, 2nd Workshop on Information Theoretic Methods in Science and Engineering (WITMSE), 17.-19.08.2009, Tampere.

D. Vogel (C3): On Generalizing Gaussian Graphical Models, 16th European Young Statisticians Meeting (EYSM), 24.-28.08.2009, Bukarest.

S. Voß (A1): Sensitivität des Ratings auf die Makroökonomie, Statistische Woche 2009, 05.-08.10.2009, Wuppertal.

C. Weihs (B3, B4, C2): Distances in Classification, Hauptvortrag auf der 9th Industrial Conference on Data Mining (ICDM 2009), 20.-22.07.09, Leipzig.

C. Weihs (B3, B4, C2): Extended Features for Automatic Speech Recognition by Means of Auditory Modelling, EUSIPCO 2009, 24.-28.08.09, Glasgow.

C. Weihs (B3, B4, C2): (Statistical) Music software First Bilateral German-Polish Symposium on Data Analysis and Its Applications, 08.-10.10.09, Aachen.

C. Weihs (B3, B4, C2): Visualisierung statistischer Daten, Informationsvisualisierung – Grafische Aufbereitung und Analyse von statistischen Daten, Wiss. Kolloquium, Statistisches Bundesamt, 19.-20.11.09, Wiesbaden.

D. Wied (A1): A fluctuation test for constant correlation, Statistische Woche 2009, 05.-08.10.2009, Wuppertal.

3) Poster

A. Bücher (A1): Wild Bootstrap approximation of empirical tail copulas, Workshop on Copula Theory and its Applications, 25.-26.09.2009, Warschau.

Abschlussarbeiten

K. A. Abnaof (C3): Categorical time series analysis methods: comparison und evaluation.

R. Bensaid (C3): Robuste Hauptkomponentenanalyse.

L. Labi (A1): Credit Scoring for Group Lending in Microfinance: Case Study Ivory Coast

Sonstiges

H. Dehling (C3): Mitglied im Programmkomitee des Workshop on Limit Theorems, Prag, 03.08. – 06.08.2009.

R.Fried (C3): Organisation & Leitung einer Sektion "Online Monitoring" bei der 57. Session des Internationalen Statistischen Instituts, Durban, 16.08.-22.08.2009.

R.Fried (C3): Organisation & Leitung des Tracks "Time Series Modelling and Computation" sowie wissenschaftliches Programmkomitee *ERCIM Workshop*, Limassol, 29.10. – 31.10.2009.

W. Leininger (A5): Vertretung des SFBs 823 auf der SFB-Sprechertagung, Universität Potsdam, 27.09. – 28.09.2009.

Gastwissenschaftler

B. H. Baltagi (Syracuse University, NY): Spatial panels, 07.07.2009.

G. Claeskens (Katholieke Universiteit Leuven): A short course in model selection, 07.-08.09.2009.

- M. Eugster (Ludwig-Maximilians-Universität München): Benchmark Experiments - Comparing Statistical Learning Algorithms, 28.09.2009.
- B. Fitzenberger (Albert-Ludwigs-Universität Freiburg): The Heterogeneous Effects of Training Incidence and Duration on Labor Market Transitions, 26.10.2009.
- C. Heuchenne (Université de Liège): Parametric Checks for Censored Regression Models, 20.08.2009.
- S. Hoderlein (Brown University, Providence): Local Partitioned Regression, 27.07.2009.
- C. Kirch (Universität Karlsruhe (TH)): Resampling Methods in Change-Point Analysis, 01.12.2009.
- V. B. Melas (St. Petersburg State University): Vorträge zu: 'Optimal designs for estimating the slope of nonlinear regression models', 'All-bias designs' und 'Design of Experiments for inverse problems', 03.07.-31.07.2009.
- F. Merlevède (Université Paris-Est, Marne-la-Vallée): Weak invariance principles for linear processes with application to isotonic regression, 08.12.2009.
- F. Schmid (Universität zu Köln): Copula-Based Measures of Multivariate Association, 15.12.2009.
- M. Stehlik (Johannes Kepler Universität Linz): Optimal designs for Correlated Processes, 10.11.2009.

Workshops, Tagungen

vergangene:

Nonparametrics Statistics and Time Series – Conference in Honor of Marc Hallin, 27.-28.11.2009 in Brüssel.

Organisation mit Hilfe des SFBs: Université libre de Bruxelles.

Details unter: <http://mh2009.ulb.ac.be/>

zukünftige:

DAGStat 2010, 23.03-26.03.2010 an der Technischen Universität Dortmund.

Organisation mit Hilfe des SFBs: J. Rahnenführer, K. Kammers.

Details unter: <http://www.statistik.tu-dortmund.de/DAGStat2010/>

9th Workshop on Quality Improvement, 14.05. - 15.05.2010 im Universitätskolleg der TU Dortmund in Witten-Bommerholz.

Organisation für den SFB: J. Kunert und C. Weihs.

Details unter: http://www.statistik.uni-dortmund.de/workshop_quality_eng.html

Symposium über Hochfrequenzdaten in der Finanzökonomie, 01.07. - 02.07.2010 Universitätskolleg der TU Dortmund in Witten-Bommerholz.

Organisation für den SFB: W. Krämer.

Workshop "**Time Series, Financial Statistics and Quantile Regression**", 20.09. - 21.09.2010 im Campus-Treff an der Technischen Universität Dortmund.
Organisation für den SFB: H. Dette, U. Gather und M. Hallin.

Die SFB-Akademie

Unser SFB will wissenschaftlichen Nachwuchs auch außerhalb der traditionellen Akademiker-Laufbahn fördern. Dazu dient die SFB-Akademie. Das ist eine zwanglose Plattform, wo Nachwuchswissenschaftler aus Wirtschaft, Technik und Statistik Ideen austauschen und - auf ihre Bedürfnisse zugeschnitten – Sekundärtugenden erlernen können, und zwar ohne etablierte Fachkollegen und Projektleiter ("bonzenfreie Zone").

Es gibt vier Themenzirkel ('Finanzdaten', 'Strukturbruch', 'Versuchsplanung' und 'Inverse Probleme'), dazu haben sich bisher 34 SFB'ler angemeldet. In den Themenzirkeln finden selbstorganisierte Arbeitstreffen statt. Bei den ersten Treffen haben die Teilnehmer sich auf einem für SFB'ler aller Fachrichtungen verständlichen Niveau gegenseitig ihre Arbeitsgebiete vorgestellt – das wird reihum noch einige Zeit so weitergehen.

Parallel dazu bietet die SFB-Akademie gelegentlich Einführungskurse und -vorträge zu verschiedenen Fachthemen an. Wer einen solchen abhalten oder anregen möchte, ist dazu herzlich eingeladen. Bisher fanden statt: "Copulae" von Pavel Stoimenov (TU Dortmund) im Juli 2009 und "A Short Course in Model Selection" von Gerda Claeskens (Katholische Universität Löwen) im September 2009. Im März 2010 gibt Claus Weihs (TU Dortmund) einen Einführungslehrgang in Versuchsplanung.

Für den ersten fachübergreifenden Kursus "Stimm- und Sprechtraining" (10. Dezember 2009) konnten wir Reinhard Pede gewinnen, Deutschlands bekanntesten Sprechtrainer, tätig für den Deutschlandfunk, arte, das ZDF und WDR. Von ihm haben die Kursteilnehmer gelernt, wie sie deutlich, im richtigen Tempo und mit Dynamik sprechen, um sich auf Konferenzen oder in Seminaren gut zu präsentieren. Im Januar 2010 ist ein Kurs „Zwischen Chaos und Perfektion – Dissertation als Projekt managen" geplant; eine Trainerin der Bochumer „prometha Organisations- und Personal-Entwicklung“ wird mit den Teilnehmern Techniken aus Zeit- und Projektmanagement erarbeiten, um eine Dissertation optimal zu planen und durchzuführen.

Informationen zu allen Lehrgängen, Vorträgen und Themenzirkeln gibt es auch auf der Internetseite der SFB-Akademie

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/1166.html>.

Ich freue mich auf viele weitere spannende Kurse und Vorträge!

Aeneas Rooch, Leiter der SFB-Akademie

Diskussionspapiere

- 36/09 D. Vogel und R. Fried (beide C3): On robust Gaussian Graphical Modelling.
- 35/09 O. Sh. Shapirov und M. Wendler (C3): Bootstrap for the sample mean and for U-Statistics of stationary processes.
- 34/09 H. Dehling und M. Wendler (beide C3): Law of the iterated logarithm for U-Statistics of weakly dependent observations Discussion.
- 33/09 F. Jüßen, L. Linnemann und A. Schabert (alle A4): Default risk premia on government bonds in a quantitative macroeconomic model.
- 32/09 A. Bücher und H. Dette (beide A1): A note on bootstrap approximations for the empirical copula process.
- 31/09 Y. Rozenholc, T. Mildenerger und U. Gather (beide C1): Combining regular and irregular histograms by penalized likelihood.
- 30/09 W. Krämer (A1, A4) und M. Bücker: Statistischer Qualitätsvergleich von Kreditausfallprognosen.
- 29/09 N. Bissantz (C4), H. Dette (C1) und K. Proksch (C4): Model checks in inverse regression models with convolution-type operators.
- 28/09 M. Podolskij und M. Vetter (A1): Understanding limit theorems for semimartingales: A short survey.
- 27/09 A. Bücher, H. Dette und G. Wieczorek (alle A1): Testing model assumptions in functional regression models.
- 26/09 S. Biedermann, H. Dette (C2) und D. C. Woods: Optimal designs for multivariable spline models.
- 25/09 H. Dette (A1, C1, C2) und C. Heuchenne: Scale checks in censored regression.
- 24/09 H. Dette (A1, C1, C2) und A. Pepelyshev: Generalized Latin hypercube design for computer experiments.
- 23/09 S. Volgushev und H. Dette (A1, C1, C2): Nonparametric quantile regression for twice censored data.
- 22/09 M. Hallin (C1), D. Paindaveine und M. Siman: Multivariate quantiles and multiple-output regression quantiles: From L_1 optimization to halfspace depth.
- 21/09 H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: A new approach to optimal designs for models with correlated observations.
- 20/09 H. Dette und M. Trampisch (beide C2): A general approach to D-optimal designs for weighted univariate polynomial regression models.
- 19/09 H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und P. Shpilev: Optimal designs for estimating the slope in nonlinear regression.

- 18/09 H. Dette (A1, C1, C2), J. Wagener und S. Volgushev: Nonparametric analysis of covariance using quantile curves.
- 17/09 H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev und T. Holland-Letz: Optimal designs for random effect models with correlated errors with applications in population pharmacokinetics.
- 16/09 H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev und W. K. Wong: Optimal designs for composed models in pharmacokinetic-pharmacodynamic experiments.
- 15/09 H. Dette (A1, C1, C2), C. Kiss, M. Bevanda und F. Bretz: Optimal designs for the EMAX, log-linear and exponential model.
- 14/09 H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und P. Shpilev: Optimal designs for trigonometric regression models.
- 13/09 H. Dette (A1, C1, C2), N. Leonenko, A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Asymptotic optimal designs under long-range dependence error structure.
- 12/09 W. Krämer (A1, A4), B. T. Azamo und K. Christou: On the origins of high persistence in GARCH-models.
- 11/09 H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev, P. Shpilev und W. K. Wong: Optimal designs for discriminating dose response models in toxicology studies.
- 10/09 K. F. Siburg und P. A. Stoimenov (A1): Regression Dependence.
- 09/09 H. Dette (A1, C1, C2) und M. Marchlewski (C4): A robust test for homoscedasticity in nonparametric regression.
- 08/09 J. Kaiser und W. Krämer (A1, A4): A cautionary note on computing conditional from unconditional correlations.
- 07/09 T. Holland-Letz, H. Dette (A1, C1, C2) und A. Pepelyshev: A geometric characterization of c-optimal designs for regression models with correlated observations.
- 06/09 A. Bücher und H. Dette (beide A1): Some comments on goodness-of-fit tests for the parametric form of the copula based on L^2 -distances.
- 05/09 M. Birke (C4), H. Dette (A1, C1, C2) und K. Stahljans: Testing symmetry of a nonparametric bivariate regression function.
- 04/09 W. Krämer (A1, A4), M. van Kampen: A simple nonparametric test for structural change in joint tail probabilities.
- 03/09 D. Wied und M. Arnold (beide A1, A4): A fluctuation test for constant correlation.
- 02/09 C. Höhenrieder, L. Davies und W. Krämer (A1, A4): Recursive estimation of piecewise constant volatilities.
- 01/09 M. Vetter und H. Dette (beide A1): Model checks for the volatility under microstructure noise

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter: <http://www.statistik.tu-dortmund.de/1167.html>

