

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

Ausgabe 10

Sprecher: Prof. Dr. Walter Krämer
Geschäftsstelle: Melanie Große
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



SFB
823

Liebe Mitglieder des SFB 823,

das war doch ein ertragreiches Treffen in Lüdenscheid – zwei Tage sind besser als einer, ich habe viel gelernt, das machen wir im Oktober 2015 genauso. Dass ein SFB mehr sein muss als die Summe seiner Teile, brauche ich ja nicht zu betonen, und dazu hat auch diese Klausurtagung wieder kräftig beigetragen. Wenn ich mir die in diesem Info-Brief aufgelisteten Publikationen und Arbeitspapiere ansehe, fällt mir z. B. der große Anteil projektübergreifender Koautorenschaften auf, mit vielen Ergebnissen, die es ohne unseren SFB nie gegeben hätte. In diesem Sinne sind also die für unseren SFB ausgegebenen 2 Millionen € jährlich gut investiert. Wenn wir so weitermachen, müssen wir uns wegen der dritten Förderphase keine Sorgen machen.

Gut gefällt mir auch die große Zahl externer Vorträge und Präsentationen auf Konferenzen. Wie sagte doch schon der alte Konfuzius so schön (oder war es Luther oder Einstein): Tue Gutes und rede darüber. Wir haben einiges an Gutem zu bieten, also zeigen wir es auch.

Und dann möchte ich diesen Rundbrief zum Anlass nehmen, mich bei der guten Seele unseres SFB, bei Melanie Große, für ihre perfekte Organisation unseres Verbundes zu danken, den sie zusammen mit Thorsten Ziebach seit Jahren so geräuschlos wie effizient durch die Untiefen des DFG-Vergabewesens steuert. Melanie wird am 14. November 40. Wir wünschen ihr alles alles Gute.

Ihr SFB-Sprecher Walter Krämer



Seit Anfang des SFB am Steuer der Finanzen:
Unser Geburtstagskind Melanie Große

Rufe, Ehrungen und Preise

Christoph M. Schmidt bzw. **Manuel Frondel (beide A3)** belegten beim FAZ-Ranking der einflussreichsten Ökonomen Deutschlands die Plätze 10 bzw. 20 (von über 2.000).

Walter Krämer (A1) war diesjähriger Thünen-Redner auf der Jahresversammlung des Vereins für Socialpolitik in Hamburg (mit mehr als 3.000 Mitgliedern eine der größten Ökonomen-Vereinigungen der Welt).

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

M. Andor, M. Frondel und C. Vance (alle A3): Hypothetische Zahlungsbereitschaft für grünen Strom: Bekundete Präferenzen privater Haushalte für das Jahr 2013, erscheint in: *Perspektiven der Wirtschaftspolitik*.

A. Aue, C. Dienes, S. Fremdt (A1) und J.G. Steinebach: On-line monitoring schemes for autoregressive moving average time series, erscheint in: *Bernoulli*.

J. Dedecker, H. Dehling (C1, C3), M. S. Taqqu: Weak convergence of the empirical process in L^2 under Long-range dependence, erscheint in: *Stochastics and Dynamics* 14. DOI: 10.1142/S0219493715500082.

H. Dette (A1, C1, C2), R. Van Hecke und S. Volgushev (beide C1): Some comments on copula-based regression, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

H. Dette (A1, C1, C2) und C. Kiss (C2): Optimal designs for rational regression models, erscheint in: *Journal of Statistical Theory and Practice*.

S. Fischer und A. Schumann (beide B6): Comment on the paper of P. Willems: Multidecadal oscillatory behaviour of rainfall extremes in Europe, aus: *Climatic Change* 120 (4), 931-944, erscheint in: *Climatic Change*.

S. Fremdt (A1): Page's sequential procedure for change-point detection in time series regression, erscheint in *Statistics*. doi:10.1080/02331888.2013.870568.

W. Krämer (A1): Zur Ökonomie von Panik, Angst und Risiko, erscheint in: *Perspektiven der Wirtschaftspolitik*.

T. Liboschik (C3), P. Kerschke, K. Fokianos und R. Fried (B6, C3): Modelling Interventions in INGARCH Processes, erscheint in: *International Journal of Computer Mathematics* (special issue of the ERCIM Working Group on Computational Statistics).

O. Mersmann, M. Preuss, H. Trautmann, B. Bischl (C2) und C. Weihs (C2): Analyzing the BBOB results by means of benchmarking concepts, erscheint in: *Evolutionary Computation Journal*.

P. L. Pedroni, T. J. Vogelsang, M. Wagner (A3, A4) und J. Westerlund: Nonparametric Rank Tests for Non-Stationary Panels, erscheint in: *Journal of Applied Econometrics*.

P. Preuß (C1), R. Puchstein (A1) und H. Dette (A1, C1, C2): Detection of multiple structural breaks in multivariate time series, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

K. Proksch (C4): On confidence bands for multivariate nonparametric regression, erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.

M. Schulte und A. Schumann (beide B6): Downstream-directed performance assessment of reservoirs in multi-tributary catchments by application of multivariate statistics, erscheint in: *Water Resources Management*.

C. Vance und N. Ritter (beide A3): Is Peace a Missing Value or a Zero?, erscheint in: *Journal of Peace Research*.

D. Vogel (C3) und D. E. Tyler: Robust estimators for nondecomposable elliptical graphical models, erscheint in: *Biometrika*.

M. Wagner (A3, A4): The Environmental Kuznets Curve, Cointegration and Nonlinearity, erscheint in: *Journal of Applied Econometrics*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

M. Andor, M. Frondel (beide A3) und S. Sommer: Klimawandel: Wahrnehmung und Einschätzungen der deutschen Haushalte im Herbst 2012, *Zeitschrift für Energiewirtschaft* 38 (1), 1-12 (2014).

M. Arnold und D. Wied (beide A1): Improved GMM Estimation of Random Effects Panel Data Models With Spatially Correlated Error Components, *Papers in Regional Science* 93 (1), 77-99 (2014).

T. K. Bauer, S. Bender, A. Paloyo und C. M. Schmidt (A3): Do Guns Displace Books? The Impact of Compulsory Military Service on Educational Attainment, *Economics Letters* 124 (3), 513-515 (2014).

T. Berens, D. Wied (A1) und D. Ziggel: Automated Portfolio Optimization Based on a New Test for Structural Breaks, *Acta Universitatis Danubius: Œconomica* 10 (2), 241-262 (2014).

B. Berghaus und A. Bücher (beide A7): Nonparametric tests for tail monotonicity. *Journal of Econometrics* 180 (2), 117-126 (2014).

M. Borowski und R. Fried (B6, C3): Online Signal Extraction by Robust Regression with Moving Windows With Adaptive Window Selection, *Statistics and Computing* 24, 597-613.

J. Buchsteiner (C1): Weak convergence of the sequential empirical process of some long-range dependent sequences with respect to a weighted norm, *Statistics and Probability Letters* 96, 170-179 (2015).

- A. Bücher (A7): A note on nonparametric estimation of bivariate tail dependence, *Statistics & Risk Modeling* 31 (2), 151-162 (2014).
- A. Bücher (A7), I. Kojadinovic, T. Rohmer und J. Segers: Detecting changes in cross-sectional dependence in multivariate time series, *Journal of Multivariate Analysis* 132, 111-128 (2014).
- A. Bücher (A7) und J. Segers: Extreme value copula estimation based on block maxima of a multivariate stationary time series, *Extremes* 17 (3), 495-528.
- A. Bücher (A7), J. Segers und S. Volgushev (C1): When uniform weak convergence fails: Empirical processes for dependence functions and residuals via epi- and hypographs, *Annals of Statistics* 42 (4), 1598-1634 (2014).
- I. Burghaus und H. Dette (A1, C1, C2): Optimal designs for nonlinear regression models with respect to non-informative priors, *Journal of Statistical Planning and Inference* 154, 12-25 (2014).
- H. Dehling (C1, C3): Comments on: Extensions of some classical methods in change point analysis, *Test* 23, 261-264 (2014).
- H. Dehling (C1, C3), O. Durieu and M. Tusche (C1): Approximating class approach for empirical processes of dependent sequences indexed by functions, *Bernoulli* 20, 1372-1403 (2014).
- H. Dehling (C1, C3), O. Durieu und M. Tusche (C1): A Sequential Empirical Central Limit Theorem for Multiple Mixing Processes with Application to B-Geometrically Ergodic Markov Chains, *Electronic Journal of Probability* 19 (87), 1-26 (2014).
- H. Dehling (C1, C3), O. S. Sharipov, M. Wendler (C1, C3): Bootstrap for dependent Hilbert space valued random variables with applications to von Mises statistics, *Journal of Multivariate Analysis* 133, 200-215. (2015).
- L. Denecke, Ch. H. Müller (beide B5): New robust tests for the parameters of the Weibull distribution for complete and censored data, *Metrika* 77, 585-607 (2014).
- H. Dette (A1, C1, C2) und Y. Grigoriev: E-optimal designs for second-order response surface models, *Annals of Statistics* 42 (4), 1635-1656 (2014).
- A. Dürre, D. Vogel (beide C3) und D. E. Tyler: The spatial sign covariance matrix with unknown location, *Journal of Multivariate Analysis* 130, 107-117 (2014).
- H. Elsaied und R. Fried (B6, C3), Robust Fitting of INARCH Models, *Journal of Time Series Analysis* 35, 517-535 (2014).
- S. Fremdt (A1), L. Horváth, P. Kokoszka and J. G. Steinebach: Functional Data Analysis with Increasing Number of Projections, *Journal of Multivariate Analysis* 124, 313-332 (2014).
- R. Fried (B6, C3), T. Liboschik (C3), H. Elsaied, K. Fokianos, und S. Kitromilidou, On Outliers and Interventions in Count Time Series Following GLMs, *Austrian Journal of Statistics* 43 (special issue CDAM 2013), 181-193 (2014).
- M. Frondel und C. M. Schmidt (beide A3): A Measure of a Nation's Physical Energy Supply Risk, *Quarterly Review of Economics and Finance* 54 (2), 208-215 (2014).

- M. Frondel, C. M. Schmidt und C. Vance (alle A3): Revisiting Germany's Solar Cell Promotion: An Unfolding Disaster, *Economic Analysis and Policy* 44 (1), 3-13 (2014).
- M. Frondel und C. Vance (beide A3): More Pain at the Diesel Pump? An Econometric Comparison of Diesel and Petrol Price Elasticities, *Journal of Transport Economics and Policy* 48 (3), 449-463 (2014).
- P. Galeano und D. Wied (A1): Multiple Break Detection in the Correlation Structure of Random Variables, *Computational Statistics and Data Analysis* 76, 262-282 (2014).
- B. Hussong (B1), W. Luo und W. Tillmann (B1): Einfluss der Substrattemperatur und Substrathärte auf die Splatbildung WC-basierter Cermetpulver beim HVOF Spritzen, *Thermal Spray Bulletin* 2/12, 148-153 (2014).
- S. Kuhnt (B1), F. Rapallo und A. Rehage (B1): Outlier detection in contingency tables based on minimal patterns, *Statistics and Computing* 24 (3), 481-491 (2014).
- M. Lang, H. Kotthaus, P. Marwedel, C. Weihs (C2), J. Rahnenführer und B. Bischl (C2): Automatic model selection for high-dimensional survival analysis, *Journal of Statistical Computation and Simulation* 85 (1), 62-76 (2015).
- A. R. Reichert und H. Tauchmann (beide A3): When Outcome Heterogeneously Matters for Selection – A Generalized Selection Correction Estimator, *Applied Economics* 46 (7), 762-768 (2014).
- T. J. Vogelsang und M. Wagner (A3, A4): Integrated Modified OLS Estimation and Fixed-b Inference for Cointegrating Regressions, *Journal of Econometrics* 178, 741-760 (2014).
- G. Weiß (A7): Identifying mixture copula components using outlier detection methods and goodness-of-fit tests, *Journal of Risk* 16, 61-101 (2014).
- G. Weiß und J. Mühlnickel (beide A7): Why do some insurers become systemically relevant?, *Journal of Financial Stability* 13, 95-117 (2014).
- D. Wied (A1), H. Dehling (C3), M. van Kampen (A1) und D. Vogel (C3): A Fluctuation Test for Constant Spearman's Rho With Nuisance-Free Limit Distribution, *Computational Statistics and Data Analysis* 76, 723-736 (2014).
- D. Ziggel, T. Berens, G. Weiß (A7) und D. Wied (A1): A New Set of Improved Value-at-Risk Backtests, *Journal of Banking and Finance* 48, 29-41 (2014).

2) Veröffentlichungen in Sammelbänden, Buchbeiträge, Bücher (nur bereits erschienene)

- B. Bischl (C2), J. Schiffner und C. Weihs (C2): Benchmarking classification algorithms on high-performance computing clusters, in: M. Spiliopoulou, L. Schmidt-Thieme und R. Janning (Hrsg.): *Data Analysis, Machine Learning and Knowledge Discovery, Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization*, Springer International Publishing Switzerland, 23-31 (2014).

B. Hussong (B1), W. Luo und W. Tillmann (B1): Untersuchung der Splatmorphologien eines WC-FeCrAl-Pulvers beim HVOF-Spritzen auf Substrate mit unterschiedlichen Temperaturen und Härten, Schriftenreihe Werkstoffe und werkstofftechnische Anwendungen Band 052, Hrsg. TU Chemnitz, Fak. f. Maschinenbau, Institut für Werkstoffwissenschaft und Werkstofftechnik, B. Wielage, 73-81 (2014).

W. Krämer (A1), G. Gigerenzer und Th. Bauer: Warum dick nicht doof macht und Genmais nicht tötet, Campus-Verlag, Frankfurt (2014).

W. Krämer (A1) und H. Müller: Hat der Euro noch eine Zukunft?, Campus-Verlag, Frankfurt (2014).

A. Rehage und S. Kuhnt (beide B1): An angle-based functional depth measure for outlier detection, Contributions in Infinite-Dimensional Statistics and Related Topics, in: E. G. Bongiorno, E. Salinelli, A. Goia und P. Vieu (Hrsg.), Bologna: Società Editrice Esculapio, 233-238 (2014).

A. Roach (C3): Statistik für Ingenieure, Springer Spektrum, Berlin Heidelberg (2014).

3) Populärwissenschaftliche Texte

H. Dehling (C1, C3), E. Glasmachers und J. Härterich: MP²-Mathe/Plus/Praxis, *Mitteilungen der Deutschen Mathematikervereinigung* 22, 113-115 (2014).

H. Dehling (C1, C3), B. Griese, E. Glasmachers, J. Härterich und M. Kallweit: MP²-Mathe/Plus/Praxis, Strategien zur Vorbeugung gegen Studienabbruch, *Zeitschrift für Hochschulentwicklung* 9 (2014).

H. Dehling (C1, C3), K. Roegner und M. Winzker: Editorial: Transfer von Studienreformprojekten für die Mathematik in den Ingenieurwissenschaften, *Zeitschrift für Hochschulentwicklung* 9 (2014).

H. Dehling (C1, C3), K. Roegner und M. Winzker (Gastherausgeber): Sonderheft "Transfer von Studienreformprojekten für die Mathematik in den Ingenieurwissenschaften", *Zeitschrift für Hochschulentwicklung* 9 (4) (2014).

4) Medienbeiträge

M. Andor, M. Frondel und C. Vance (alle A3): Zahlungsbereitschaft für grünen Strom: Die Kluft zwischen Wunsch und Wirklichkeit, *Ökonomenstimme*, 14.08.2014.

M. Frondel (A3): Bringt uns die Energiewende wirklich mehr, als sie kostet? Gastbeitrag für "kontrovers" im Newsletter *Energiewende direkt* des BMWI. <http://www.bmwi-energiewende.de/EWD/Redaktion/Newsletter/2014/21/Meldung/kontrovers-hoffmann-frondel.html>

M. Frondel (A3): Wie viel Potential steckt im Energie-Sparen? *SWR2 Forum*, 07.08.2014. <http://www.swr.de/swr2/programm/sendungen/swr2-forum/wie-viel-potential-steckt-im-energie-sparen/-/id=660214/did=13941432/nid=660214/a9oss0/index.html>

W. Krämer (A1): Kampf dem Innumeratentum, *Capital*, 13.08.2014.

W. Krämer (A1): Wie die Titanic, *Börse aktuell*, 23.07.2014.

W. Krämer (A1): Panik ist ein gutes Geschäftsmodell, *DiePresse.com*, 26.09.2014.

W. Krämer (A1): Das Gerede von der Armut, *Frankfurter Rundschau*, 06.10.2014.

C. M. Schmidt und M. Frondel (beide A3): Auf Wiedervorlage. Die Reform des EEG verfehlt eklatant ihr Ziel, *Handelsblatt*, 08.04.2014.

C. M. Schmidt (A3): Die Rente mit 63 ist fatal, Gastbeitrag in der *Frankfurter Allgemeine Sonntagszeitung*, 13.04.2014.

C. M. Schmidt (A3): Am Kern des Problems vorbei, *Handelsblatt*, 31.07.2014.

C. M. Schmidt (A3): Die Lohnpolitik allein löst das Problem nicht, *Die Welt*, 31.07.2014.

5) Sonstige

M. Konstantinou (C2), S. Biedermann und A. C. Kimber: Optimal designs for full and partial likelihood information - with application to survival models, University of Southampton, Preprint.

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

H. Dehling (C1, C3): Empirical Processes of Dependent Data, Conference on Asymptotic Results in Probability and Statistics, in honor of E. Csáki and P. Révész, Budapest, Ungarn, 21.-23.08.2014.

K. Ickstadt (B5): Prediction of Growth Curves - A Bayesian Estimation Approach, ENBIS 14, Linz, Österreich, 21.-25.09.2014.

W. Krämer (A1): So lügt man mit Statistik, 50 Jahre Forschungsinstitut für Kinderernährung, Dortmund, 06.06.2014 (auch: Festkolloquium zur Verabschiedung von Prof. Gerhard Arminger, Bergische Universität, Wuppertal, 01.07.2014.

W. Krämer (A1): Zur Ökonomie von Panik, Angst und Risiko, Thünen-Vorlesung 2014, Verein für Socialpolitik - Jahrestagung 2014, Hamburg, 07.-10.09.2014.

A. Schumann (B6): Flood risk Estimation for German reservoirs, Opstartseminar til FlomQ, Oslo, Norwegen, 07.-08.05.2014.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen

D. Belomestny (C5): Statistical Skorohod embedding problem and its generalizations, Workshop on Statistical Inference for Lévy Processes, Lorentz-Center, Leiden, Niederlande, 22.-25.09.2014.

D. Belomestny (C5): Quantile Estimation in Statistical Skorohod Embedding Problem, Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Measurement, Kloster Drübeck, 18.-20.05.2014.

H. Dehling (C1, C3): Robust Change Point Tests for Time Series, Workshop on Recent Advances and Trends in Time Series Analysis, BIRS, Banff, Kanada, 27.04.-02.05.2014 (auch: SSC 2014: Annual Meeting of the Statistical Society of Canada, Toronto, 25.-28.05.2014; Prague Stochastics Workshop: Limit Theorems, Prag, Tschechien, 25.-29.08.2014).

H. Dette (A1): Non-stationarity versus long range dependence, Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Measurement, Kloster Drübeck, 18.-20.05.2014.

J. Franke (A5): Workers' Participation in Wage Setting and Opportunistic Behavior: Evidence from a Gift-Exchange Experiment, 17th Conference of the International Association for the Economics of Participation (IAFEP), Montevideo, Uruguay, 16.-18.07.2014.

S. Fremdt (A1): Estimation of high-dimensional spectral density matrices under sparsity constraints, 11th German Probability and Statistics Days, Ulm, 04.-07.03.2014.

S. Fremdt (A1): Variable selection and dimension reduction criteria in functional regression models, 2nd Conference of the International Society for NonParametric Statistics, Cádiz, Spanien, 12.-16.06.2014.

R. Fried (B6, C3), H. Dehling (C1, C3) und M. Wendler (C1): A Robust Procedure for Shift Detection in Time Series, Nordstat, Turku, Finnland, 02.-05.06.2014.

B. Hussong (B1): Untersuchung der Splatmorphologien eines WC-FeCrAl-Pulvers beim HVOF-Spritzen auf Substrate mit unterschiedlichen Temperaturen und Härten, 17. Werkstofftechnisches Kolloquium, Chemnitz, 11.-12.09.2014.

W. Krämer (A1): Unwahrscheinliche Wahrscheinlichkeiten, Jahrestagung des MNU-Landesverbands Westfalen, Dortmund, 02.09.2014.

C. Kustosz (B5): Application of Data Depth to Models in Construction Engineering, 13th Workshop on Quality Improvement Methods, Dortmund, 20.-21.06.2014.

C. Kustosz (B5): Simplicial Depth for Growth Models in Construction Engineering, 21st International Conference on Computational Statistics (COMPSTAT14), Genf, Schweiz, 19.-22.08.2014.

T. Liboschik (C3), K. Fokianos und R. Fried (B6, C3): An R package for the analysis of count time series, Statistische Woche, Hannover, 16.-19.09.2014.

Ch. H. Müller (B5): Data Depth for Autoregression, 2014 International Indian Statistical Association (IISA) Conference, Riverside, U.S.A., 11.-13.07.2014 (auch: ICORS2014: 14th International Conference on Robust Statistics 2014, Halle, 10.-15.08.2014; Statistische Woche 2014, Hannover, 16.-19.09.2014).

K. Pape (A1): Monitoring Multivariate Variance Changes, Statistische Woche 2014, Hannover, 16.-19.09.2014.

N. Rudak und S. Kuhnt (beide B1): Modelling and Controlling of a Thermal Spraying Process, ENBIS-14, Linz, Österreich, 22.-24.09.2014.

N. Rudak, S. Kuhnt (beide B1) und E. Riccomagno: Modelling of a thermal spraying process by Gaussian chain graph models, 2014 ENBIS-SFdS Spring Meeting, Paris, Frankreich, 09.-11.04.2014.

C. M. Schmidt (A3): Recovery in the Euro Area - No Reason for Complacency, 7. German Conference at Harvard 2014, Harvard University, Cambridge, U.S.A., 14.02.2014 (auch: Director's Breakfast at Chatham House, Royal Institute of International Affairs Chatham House, London, Großbritannien, 21.05.2014).

C. M. Schmidt (A3): Alter und Beschäftigung: Wie lässt sich der Rückgang der Anzahl der Erwerbstätigen kompensieren?, Nordrhein-Westfälische Akademie der Wissenschaften und Künste, Vortragsreihe *Folgen Demografischen Wandels – Altern/Alterssicherung*, Düsseldorf, 17.06.2014.

A. Schnurr (C5): A Unified Approach to Analyze Levy-Type Processes, Vilnius Conference, Litauen, 30.06.-04.07.2014.

A. Schnurr (C5): Limit Theorems for Ordinal Pattern Dependence and Their Application to Medical/Biological Data, DynStoch-Meeting, Warwick, Großbritannien, 10.-12.09.2014.

M. van Kampen (A1): Convergence rates of sieve estimators of nonlinear cointegration models, Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Measurement, Kloster Drübeck, 18.-20.05.2014.

N. Ritter (A3): Do Major Brands Have Market Power in the German Retail Gas Market?, International Association for Energy Economics (IAEE), 15.-18.06.2014, New York, U.S.A. (auch: International Workshop on Empirical Methods in Energy Economics (EMEE), 14.-15.08.2014, Aachen).

S. Volgushev (A1): Quantile spectral analysis, 4th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series, Rom, Italien, 11.09.2014.

M. Wagner (A3, A4): Some Extensions of Regression Based Cointegration Analysis, Meeting of the Swiss Society of Economics and Statistics, Bern, Schweiz, 24.-25.05.2014 (auch: Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Measurement, Kloster Drübeck, 18.-20.05.2014).

M. Wagner (A3, A4): Monitoring Stationarity and Cointegration, 29th Annual Congress of the European Economic Association and 68th European Meeting of the Econometric Society, Toulouse, Frankreich, 25.-29.08.14.

C. Weihs (C2, B3, B4), S. Herbrandt (B4), M. Ferreira (B4), C. Rautert (B4), D. Biermann (B4) und W. Tillmann (B1, B4): Optimization of a Simulation for Inhomogeneous Mineral Subsoil Machining, European Conference on Data Analysis 2014, Bremen, 02.-04.07.2014.

G. Weiß (A7): Systemic Risk and the Interconnectedness of Insurers Around the Globe, SAFE-ICIR-Workshop on *Banking and Insurance – Interconnectedness, Systemic Risk and Regulation*, Frankfurt, 08.05.2014.

G. Weiß (A7): Crisis Sentiment and Insurer Performance, ARIA Annual Meeting 2014, Seattle, U.S.A., 06.08.2014.

G. Weiß (A7): Disclosed Derivatives Use, Securitization, And The Systemic Equity Risk Of Banks, NFA 2014 Conference, Ottawa, Kanada, 12.09.2014.

G. Weiß (A7): Determinants of systemic risk and G-SIIs, Workshop Systemic Risk in Insurance, Autorité de contrôle prudentiel et de resolution, Paris, Frankreich, 26.09.2014.

M. Wendler (C1, C3): Bootstrap for dependent Hilbert space-valued random variables, Workshop on Recent Advances and Trends in Time Series Analysis, BIRS, Banff, Kanada, 27.04.-02.05.2014.

M. Wendler (C1, C3): Sequential bootstrap for dependent Hilbert space-valued random variables, Prague Stochastics Workshop: Limit Theorems, Prag, Tschechien, 25.-29.08.2014.

D. Wied (A1): Nonparametric Tests for Constant Tail Dependence with an Application to Energy and Finance, Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Measurement, Kloster Drübeck, 18.-20.05.2014.

D. Wied (A1): Monitoring Stationarity and Cointegration, Verein für Socialpolitik - Jahrestagung 2014, Hamburg, 07.-10.09.2014 (auch Statistische Woche 2014, Hannover, 16.-19.09.2014).

D. Wied (A1): Nonparametric Tests for Constant Tail Dependence With an Application to Energy and Finance, Workshop on Non- and Semiparametric Volatility and Correlation Models - Economic Sources of Volatility, Risk Decomposition and Financial Crises, Paderborn, 24.-26.07.2014.

J. H. C. Woerner (C5): Testing for jumps in stochastic volatility models, DynStoch-Meeting, Warwick, Großbritannien, 10.-12.09.2014 (auch: Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Measurement, Kloster Drübeck, 18.-20.05.2014).

I. Zelo (B6), A. Thieler und R. Fried (B6, C3): Detection of periodic signals buried in colored noise with application to river flow and water level data, Statistische Woche, Hannover, 16.-19.09.2014.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren

M. Andor (A3): Mitigating Hypothetical Bias: Evidence on the Effects of Correctives from a Large Field Study, Umweltökonomisches Seminar, Universität Hamburg, April 2014.

A. Bücher (A7): On the block maxima method in multivariate extremes, Institut für Angewandte Mathematik, Universität Heidelberg, 23.09.2014 (auch: Statistics Seminar, Université de Pau, Frankreich, 09.10.2014; Statistics Seminar, Université catholique de Louvain, Belgien, 31.10.2014).

M. van Kampen (A1): Convergence rates of sieve estimators of nonlinear cointegration models, Ohio State University, Columbus, U.S.A., 08.09.2014.

T. Kley (C1): Quantile-Based Spectral Analysis of Time Series, Statistics Seminar, University of Illinois at Urbana-Champaign, U.S.A., 03.10.2014.

M. Konstantinou (C2): Locally optimal designs for errors-in-variables models, Seminars of the S3RI group, University of Southampton, Großbritannien, 09.10.2014.

Ch. H. Müller (B5): Prediction of Growth Processes, RWTH Aachen, 14.05.2014 (auch: Interdisziplinäres Statistik-Kolloquium der Universitäten Marburg und Gießen, 17.06.2014).

A. Schnurr (C5): A Canonical Way to Derive Properties of Lévy-Type Processes, Department of Mathematics, Oslo, Norwegen, 02.04.2014.

A. Schnurr (C5): An Ordinal Pattern Approach to Analyze Dependence Structures Between Real World Time Series, Institut für Mathematik, Universität zu Lübeck, 24.06.2014.

A. Schnurr (C5): Non-linear Leverage Effects, Statistisches Kolloquium, Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf, 14.07.2014.

S. Volgushev (A1): Quantile Spectral Analysis, ECARES, Brüssel 08.05.2014 (auch: Stochastisches Kolloquium, IMS Göttingen, 23.07.2014).

M. Wagner (A3, A4): Some Extensions of Regression Based Cointegration Analysis, CREATES University of Aarhus, Dänemark, 06.02.2014 (auch: Ohio State University, Columbus, U.S.A., 20.10.14).

M. Wagner (A3, A4): Monitoring Stationarity and Cointegration, Seminar Economics Research, Graz, Österreich, 27.06.14.

G. Weiß (A7): Disclosed derivatives use, risk exposure, and the systemic equity risk of banks, TAF Research Seminar, Paderborn, 01.07.2014.

D. Wied (A1): Monitoring Stationarity and Cointegration, Universität zu Köln, 08.04.2014 (auch: Universität Bonn, 01.07.2014).

D. Wied (A1): Misspecification Testing in a Class of Conditional Distributional Models, Universität Rostock, 28.04.2014 (auch: TU Clausthal, 22.05.2014).

D. Wied (A1): Nonparametric Tests for Constant Tail Dependence with an Application to Energy and Finance, Christian-Albrechts-Universität Kiel, 19.06.2014 (auch: Carl von Ossietzky Universität Oldenburg, 07.07.2014).

4) Poster

M. Frondel (A3): Fuel Taxes versus Efficiency Standards: An Instrumental Variable Approach, World Congress of Environmental and Resource Economists (WCERE) 28.06.-02.07.2014, Istanbul, Türkei.

S. Hermann (B5): Prediction for Stochastic Growth Processes with Jumps, ISBA Word Meeting 2014, Cancun, Mexiko, 16.07.2014.

B. Hussong (B1), W. Luo und W. Tillmann (B1): Influence of substrate temperature & carbide size on splat formation of WC-based HVOF powder, International Thermal Spraying Conference 2014, Barcelona, Spanien, 21.-23.05.2014.

T. Kley (C1): Quantile Spectral Processes: Asymptotic Analysis and Inference, NBER-NSF Time Series Conference 2014, Federal Reserve Bank of St. Louis, 26.09.2014.

A. Rehage und S. Kuhnt (beide B1): An angle-based functional depth measure for outlier detection, 3rd International Workshop on Functional and Operational Statistics, Stresa, Italien, 19.-21.06.2014.

5) Software

T. Kley (C1): quantspec: Quantile-based Spectral Analysis Functions. R package version 1.0-1 (2014).

Abschlussarbeiten

H. Akkurt, geb. Agcaer (C2): Optimale Versuchsplanung rationaler Modelle, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, Mai 2014.

M. Anstots (A7): High order B-Spline vine copulas – Application to financial econometrics, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 03.06.2014.

R. D. Aschenbruck (B5): OC-Funktion bei diskreten Lebensdauerverteilungen anhand der Poisson-Verteilung und der geometrischen Verteilung, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 03.06.2014.

D. Baberg (C3): Nichtberücksichtigung von zeitlichen Abhängigkeiten in Generalisierten Linearen Modellen, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 10.09.2014.

A. Bommert (B6): Robuste Schätzung des Parametervektors in der linearen Quantilsregression, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 15.08.2014.

M. Düker (B6, C3): Die Peak over Threshold-Methode, Bachelorarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Bau- und Umweltingenieurwissenschaften, 30.09.2014.

C. Glowiszyn (C3): Über die Optimalität des Akaike Informationskriterium in verschiedenen Modellklassen, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 25.05.2014

J. Krahl (C3): Bruch in der Abhängigkeitsstruktur eines Prozesses, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 29.09.2014.

R. Ludwig (B6): Untersuchung des Einflusses einer saisonal differenzierten hochwasserstatistischen Analyse auf die Berechnung extremer Quantile am Beispiel ausgewählter Pegel in Sachsen, Bachelorarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Bau- und Umweltingenieurwissenschaften, 10.07.2014.

D. Möller (C3): Ratio Tests auf Strukturbrucherkenung, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 24.04.2014.

- J. Mühnickel (A7): Bank Performance and Crisis Sentiment, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 27.03.2014.
- S. Nahari (B1): Thermographische Analyse der Substrataufheizung bei HVOF-gespritzten WC-FeCrAl-Verschleißschutzschichten, Diplomarbeit, Fakultät für Maschinenbau, TU Dortmund, 20.06.2014.
- M. Giese (A1): Methoden zur Berechnung optimaler Portfoliogewichte unter Berücksichtigung potentieller Strukturbrüche in der Kovarianzmatrix, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 07.08.2014.
- D. Pilic (C2): Optimale Versuchsplanung bei nichtlinearen Regressionsmodellen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, April 2014.
- B. Ritz (A1): Test auf Stationarität in periodisch-linearen Prozessen, Diplomarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, Februar 2014.
- A.-C. Schmidt (A7): Eigenkapitalausstattung und Performance von Versicherungsunternehmen, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät für Statistik, 04.09.2014.
- N. Temiz (C2): Optimale *saturated* Designs in nichtlinearen Regressionsmodellen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, Januar 2014.
- C. Ülker (B1): CFD-Simulation der Gas- und Partikeldynamik beim HVOF-thermischen Spritzen, Diplomarbeit, Fakultät für Maschinenbau, TU Dortmund, 14.04.2014.
- V. Vigneswaran (C2): Optimale Versuchsplanung für die Modellwahl, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, Juli 2014.
- S. Wallbaum (A1): GMM-Schätzer für die Parameter räumlicher MA-Abhängigkeit in Panelregressionsmodellen, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 25.08.2014.
- S. Winkler (A7): Google-Betas und Aktienrenditen, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 07.07.2014.
- N. Wunde (C5): Ordinale Muster in der Zeitreihenanalyse, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Mathematik, 30.05.2014.

Promotionen

- T. Kley (C1): Quantile-Based Spectral Analysis: Asymptotic Theory and Computation, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 23.05.2014.
- R. Puchstein (A1): Detecting deviations from stationarity, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 23.05.2014.
- K. Sen (C1): Nichtstationarität in langzeit korrelierten Prozessen, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 23.05.2014.
- H. Supper (A7): Four essays on linear and extreme dependencies in credit derivatives and equity markets, Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliche Fakultät, TU Dortmund, 16.10.2014.

Sonstiges

A. Bücher (A7) hat im Sommersemester 2014 eine W2-Professur für mathematische Statistik an der Universität Heidelberg vertreten.

W. Krämer (A1) wurde als Vorsitzender der Jury für den Gerhard-Fürst-Preis des Statistischen Bundesamtes wiedergewählt.

Ch. H. Müller (B5) organisiert die Sektion "Statistical methods for processes in engineering and industry" beim Workshop der ERCIM Working Group on Computing and Statistics, London, 06.-08.12.2014.

M. Wendler (C1, C3) vertritt im Wintersemester 2014/2015 und im Sommersemester 2015 eine Professur für das Fach "Stochastik" an der Universität zu Köln.

SFB-Mitglieder unterwegs

T. Kley (C1) hat vom 22.09. bis zum 25.09.2014 an der University of Toronto mit Prof. Z. Zhou und vom 29.09. bis zum 02.10.2014 an der University of Chicago mit Prof. W. Wu zum Thema Zeitreihen geforscht.

M. van Kampen (A1) war vom 1. bis zum 30. September 2014 Visiting Scholar an der Ohio State University.

M. Wagner (A3, A4) hat vom 20.-24.10.2014 an der Ohio State University, Columbus, mit Prof. Robert de Jong zum Thema nichtlineare Kointegration geforscht. Vom 27.-31.10.2014 war er dann an der Michigan State University, East Lansing, zwecks Kooperation bei Prof. Timothy Vogelsang zum Thema Spezifikationstests für kointegrierende Beziehungen und vom 03.-06.11.2014 an der Washington University Saint Louis, St. Louis, bei Prof. Werner Ploberger zum Thema Kointegration und Diffusionsprozesse.

Gastwissenschaftler

B. Clarke (School of Engineering and Information Technology, Murdoch University, Perth, Australien), 14.10.-28.10.2014: Vortrag "A Comparison of the L_2 Minimum Distance Estimator and the EM-Algorithm when Fitting k-Component Univariate Normal Distributions", 21.10.2014, und Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Statistik, TU Dortmund.

F. Dunker (Department of Economics, Boston College, Chestnut Hill, U.S.A.), 26.06.-27.06.2014: Vortrag "Parameter identification in stochastic differential equations by penalized maximum likelihood".

K. Eckle (Universität des Saarlandes, Saarbrücken), 08.-09.05.2014: Vortrag "Schwache Konvergenz in nicht-separablen metrischen Räumen".

K. Fokianos (Department of Mathematics & Statistics, University of Cyprus), 29.04.-07.05.2014: Vortrag "Biostatistical Applications of Time Series Analysis", 29.04.2014, und Forschungsaufenthalt an der Fakultät Statistik, TU Dortmund (Gambrinus-Fellowship).

- B. Franke (Département de Mathématiques, Brest, Frankreich), 04.08.-23.08.2014: Vortrag "Wie man mit Drift die Spektrallücken einer Diffusion auf S^2 beliebig vergrößern kann", Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum.
- C. Fuchs (Institute of Computational Biology, Helmholtz Zentrum München, Deutsches Forschungszentrum für Gesundheit und Umwelt), 03.06.2014: Vortrag "Bayesian Inference for Stochastic Differential Equations".
- V.B. Melas (St. Petersburg State University, Russland), 01.-30.04.2014: Vorträge: "Numerical construction of optimal discrimination designs" und "Optimal designs and Chebyshev systems" während eines Forschungsaufenthalts an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum.
- R. Meyer (Department of Statistics, University of Auckland, Neuseeland), 05.08.2014: Vortrag "Bayesian semiparametric likelihood approximations for stationary time series".
- W. Palma Manriquez (Department of Statistics, Pontificia Universidad Católica de Chile), 08.06.-11.06.2014: Vortrag "Locally stationary long memory processes".
- D. E. Tyler (Department of Statistics and Biostatistics, Rutgers - The State University of New Jersey, U.S.A.), 07.10.2014: Vortrag "Regularized M-estimators of the multivariate scatter/covariance matrix".
- W. B. Wu (Department of Statistics, University of Chicago, U.S.A.), 10.-13.05.2014: Vortrag "Estimation of High-dimensional Vector Autoregressive Processes".
- A. Zhigljavsky (Cardiff School of Mathematics, Cardiff University, Großbritannien), 24.-27.08.2014: Vortrag: "Optimal estimation in linear models with correlated errors".
- Z. Zhou (Department of Statistics, University of Toronto, Kanada), 17.-22.06.2014: Vortrag "Change-point analysis in locally stationary processes" und Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum.

Workshops, Tagungen

Kommt noch:

Short and long memory in probability and statistics - Workshop on the Occasion of Herold Dehling's 60th Birthday, 16.01.-17.01.2015, Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum.

Organisation: R. Fried (B6, C3) und Martin Wendler (C1, C3).

Bereits gewesen:

13th Workshop on Quality Improvement Methods,

21.06.-22.06.2014, nh Hotel, Dortmund.

Organisation: S. Herbrandt (B4), C. Weihs (B3, B4, C2), Ch. H. Müller (B5) und J. Kunert (C2).

http://www.statistik.tu-dortmund.de/workshop_quality_eng.html



DAGStat-Symposium 2014: Wie sehr regieren uns Indikatoren - Staatsschulden, Wohlstand und Statistik

25.04.2014, Deutsches Institut für Wirtschaftsforschung, Berlin

Organisation: Ch. H. Müller (B5), P. Schmidt, M. Giesselmann

<http://www.dagstat.de/aktivitaeten/symposium/indikatoren/>

Prague Stochastics Workshop Limit Theorems

25.-29.08.2014, Prag, Tschechien.

Organisation: H. Dehling (C1, C3), D. Volny.

Klausurtagung SFB 823,

29.09.-30.09.2014, Mercure Hotel, Lüdenscheid.

Organisation: W. Krämer, Th. Ziebach und M. Große (Z).

Methods and Challenges in Financial Risk Measurement (gemeinsam mit dem SFB 649), 18.05.-20.05.2014, Kloster Drübeck, Harz.

Organisation: W. Krämer (A1).

<https://www.statistik.tu-dortmund.de/index.php?id=1998>



4th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series,

11.09.-12.09.2014, EIEF-Einaudi Institute for Economics and Finance, Rom, Italien.

Organisation: H. Dette (A1, C1, C2), M. Hallin und M. Lippi.

http://www.eief.it/files/2014/02/announcement-workshop_11-13092014.pdf

Diskussionspapiere

- 35/14 D. Belomestny (C5) und J. Schoenmakers: Statistical skorohod embedding problem and its generalizations.
- 34/14 A. Leucht, Ch. P. Kustosoz und Ch. H. Müller (beide B5): Tests based on simplicial depth for AR (1) models with explosion.
- 33/14 Ch. P. Kustosoz, Ch. H. Müller (beide B5) und M. Wendler (C1): Simplified simplicial depth for regression and autoregressive growth processes.
- 32/14 M. Wendler (C1): The sequential empirical process of a random walk in random scenery.
- 31/14 M. Konstantinou und H. Dette (beide C2): Locally optimal designs for errors-in-variables models.
- 30/14 A. Betken (C3): Testing for change-points in long-range dependent time series by means of a self-normalized Wilcoxon test.
- 29/14 J. Buchsteiner (C1): Weak convergence of the weighted sequential empirical process of some long-range dependent data.
- 28/14 T. A. Schmitt, R. Schäfer, H. Dette (A1, C1) und T. Guhr: Quantile correlations: Uncovering temporal dependencies in financial time series.
- 27/14 K. F. Siburg und P. A. Stoimenov (A1): Almost opposite regression dependence in bivariate distributions.

- 26/14 S. Fischer und A. Schumann (B6): Comparison between classical annual maxima and peak over threshold approach concerning robustness.
- 25/14 H. Müller und W. Krämer (A1): Hat der Euro eine Zukunft?
- 24/14 T. Kley (C1): Quantile-based spectral analysis in an object-oriented framework and a reference implementation in R: The quantspec package.
- 23/14 M. Wagner (A3, A4) und D. Wied (A1): Monitoring stationarity and cointegration.
- 22/14 B. Berghaus und A. Bücher (beide A7): Goodness-of-fit tests for multivariate copula-based time series models.
- 21/14 C. Bredemeier (A4) und R. Winkler: The employment dynamics of different population groups over the business cycle.
- 20/14 J. Peters, C. Strupat und C. Vance (alle A3): Television and contraceptive use in Indonesia – A weak signal?
- 19/14 S. Chao, K. Proksch (C4), H. Dette (A1, C1) und W. Härdle: Confidence corridors for multivariate generalized quantile regression.
- 18/14 P. Galeano und D. Wied (A1): Dating multiple change points in the correlation matrix.
- 17/14 C. Bredemeier (A4): Household Specialization and the labor-supply elasticities of women and men.
- 16/14 B. Niestroj (A4): Testing uncovered interest parity under the assumption of liquidity premia.
- 15/14 B. Niestroj (A4): An empirical study on investors' preferences for liquid assets.
- 14/14 S. Skowronek, S. Volgushev, T. Kley, H. Dette (alle A1, C1) und M. Hallin: Quantile spectral analysis for locally stationary time series.
- 13/14 M. A. Andor, M. Frondel und C. Vance (alle A3): Zahlungsbereitschaft für grünen Strom: Die Kluft zwischen Wunsch und Wirklichkeit.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/sfb823-dp.htm>