

SFB  
823

# Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

## Ausgabe 15

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: [walter.kraemer@tu-dortmund.de](mailto:walter.kraemer@tu-dortmund.de)

Info-Brief



SFB  
823

Liebe Kolleginnen und Kollegen, Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter unseres schönen SFBs,

es ist geschafft! Nach der Papierform hätten wir uns ja eigentlich keine Sorgen machen müssen, aber ich hatte trotzdem nach der Verlängerungsentscheidung im Mai das Bedürfnis, mal tief durchzuatmen.

Inzwischen haben wir Zeit gehabt, aus dem Begutachtungs- in den Arbeitsmodus umzuschalten. Die Listen der seit dem letzten Infobrief zur Veröffentlichung angenommenen oder als Diskussionspapier in unsere Reihe eingestellten Arbeiten sehen schon mal sehr gut aus, wir sollten eine letzte Förderphase hinlegen, auf die wir stolz sein können.

Wie bei unserem letzten SFB 475 sehe ich darin auch diesmal weniger einen Abschluss als einen Neuanfang; viele der Beteiligten sind noch zu jung, um wissenschaftlich sozusagen in Pension zu gehen. Verschiedene Ideen zu künftigen SFBs, Transregios oder Forschergruppen sind mir auch schon zugetragen worden. Also seien wir weiter kreativ und starten mit einer zum Teil noch einzuholenden reichen Ernte zu neuen Großprojekten durch.

Zu diesem Durchstarten begrüße ich ganz besonders unsere vier neuen Projektleiter, für die dieser Einstieg – so hoffe ich – nur der erste Schritt in Richtung dieser neuen Projekte ist. Herzlich willkommen in unserem SFB!

Ihr SFB-Sprecher Walter Krämer

## Neu im SFB



Vasyl Golosnoy (A1)



Christoph Hanck (A4)



Philipp Jung (A5)



Peter Posch (A7)

## Rufe, Ehrungen und Preise

Christoph Hanck (A4) wurde zum Associate Editor von *Advances in Statistical Analysis* berufen.

Katja Ickstadt (B5) wurde in den Wissenschaftlichen Beirat des Bundesinstituts für Risikobewertung (BfR), Berlin, berufen.

Walter Krämer (A1) wurde zum Sekretar der Klasse Ingenieure und Wirtschaftswissenschaften und zum Vizepräsidenten der Nordrhein-Westfälischen Akademie der Wissenschaften und der Künste gewählt.

Walter Krämer (A1) wurde für eine weitere Amtsperiode zum Vorsitzenden der Jury für den Gerhard-Fürst-Preis des Statistischen Bundesamtes gewählt.

Martin Wagner (A3, A4) wurde zum Chief Economist und Executive Director der Slovenischen Nationalbank ernannt (und für zwei Jahre von der TU Dortmund beurlaubt).

Allen Geehrten die herzlichsten Glückwünsche!

## Veröffentlichungen

### 1) Publikationen in Fachzeitschriften

Seit dem letzten Infobrief zur Veröffentlichung angenommen:

M. Andor (A3) und Ch. Parmeter: Pseudolikelihood estimation of the stochastic frontier model, erscheint in: *Applied Economics*.

P. Bagchi, V. Characiejus (C1) und H. Dette (C1): A simple test for white noise in functional time series, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

D. Belomestny (C5), F. Comte und V. Genon-Catalot: Sobolev-Hermite versus Sobolev nonparametric density estimation on  $\mathbb{R}$ , erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.

D. Belomestny (C5) und M. Trabs: Low-rank diffusion matrix estimation for high-dimensional time-changed Lévy processes, erscheint in: *Annales de l'Institut Henri Poincaré - Probabilités et Statistiques*.

B. Berghaus und A. Bücher (beide A7): Weak convergence of a pseudo maximum likelihood estimator for the extremal index, erscheint in: *Annals of Statistics*.

A. Betken (C3) und M. Wendler (C1): Subsampling for general statistics under long range dependence, erscheint in: *Statistica Sinica*.

S. Birr (C1), H. Dette (A1, C1, C2), M. Hallin, T. Kley und S. Volgushev: On Wigner-Ville spectra and the unicity of time-varying quantile-based spectral densities, erscheint in *Parzen Special Issue of the Journal of Time Series Analysis*.

S. Birr (C1), S. Volgushev, T. Kley, H. Dette (A1, C1, C2) und M. Hallin: Quantile spectral analysis for locally stationary time series, erscheint in: *Journal of the Royal Statistical Society, Ser. B*.

R. J. Bowden, D. Ullmann (A7) und P. N. Posch (A7): Income distribution in troubled times: Disadvantage and dispersion dynamics in Europe 2005–2013, erscheint in: *Finance Research Letters*.

F. Bretz, K. Möllenhoff (A1), H. Dette (A1, C1, C2), W. Liu und M. Trampisch: Assessing the similarity of dose response and target doses in two non-overlapping subgroups, erscheint in: *Statistics in Medicine*.

A. Bücher (A7) und J. Segers: On the maximum likelihood estimator for the Generalized Extreme-Value distribution, erscheint in: *Extremes*.

B. R. Clarke, A. Höller, Ch. H. Müller (B4, B5) und K. Wamahiu: Investigation of the performance of trimmed estimators of life time distributions with censoring data, erscheint in: *Australian & New Zealand Journal of Statistics*.

H. Dette (A1, C1, C2), R. Guchenko, V. B. Melas und W. K. Wong: Optimal discrimination designs for semi-parametric models, erscheint in: *Biometrika*.

H. Dette (A1, C1, C2), K. Möllenhoff (A1), S. Volgushev und F. Bretz: Equivalence of regression curves, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

H. Dette (A1, C1, C2), K. Kettelhake, K. Schorning (C1, C2), W. K. Wong und F. Bretz: Optimal designs for active controlled dose finding trials with efficacy-toxicity outcomes, erscheint in: *Biometrika*.

H. Dette (A1, C1, C2), C. Ley und F. Rubio: Natural (non-)informative priors for skew-symmetric distributions, erscheint in *Scandinavian Journal of Statistics*.

H. Dette (A1, C1, C2), W. Wu und Z. Zhou: Change point analysis of correlation in non-stationary time series, erscheint in *Statistica Sinica*.

B. P. M. Duarte, W. K. Wong und H. Dette (A1, C1, C2): Adaptive grid semidefinite programming for finding optimal designs, erscheint in: *Statistics and Computing*.

K. Eckle (C4), N. Bissantz (C4), H. Dette (A1, C1, C2) und S. Einecke: Multiscale inference for a multivariate density with applications to X-ray astronomy, erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.

K. Eckle (C4), N. Bissantz (C4) und H. Dette (A1, C1, C2): Multiscale inference for multivariate deconvolution, erscheint in: *Electronic Journal of Statistics*.

M. Frondel (A3): Globales Preisabkommen: Ein Weg zu einer effektiven Klimapolitik? erscheint in: *Zeitschrift für Energiewirtschaft*.

M. Frondel (A3) und C. Vance (A3): Cycling on the Extensive and Intensive Margin – The Role of Paths and Prices, erscheint in: *Transportation Research Part A: Policy and Practice*.

M. Frondel (A3) und S. Sommer: Der Wert von Versorgungssicherheit mit Strom: Evidenz für deutsche Haushalte, erscheint in: *Zeitschrift für Wirtschaftspolitik*.

C. Gerstenberger (C3): Robust Wilcoxon-type Estimation of Change-Point Location under Short-Range Dependence, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

V. Golosnoy (A1) und A. Rossen: Modeling Dynamics of Metal Price Series via State Space Approach with Two Common Factors, erscheint in: *Empirical Economics*.

R. Gralla, K. Kraft (A5) und S. Volgushev: The Effects of Works Councils on Overtime Hours, erscheint in: *Scottish Journal of Political Economy*.

R. Gralla und K. Kraft (A5): Separating Introduction Effects from Selectivity Effects: The Differences in Employment, Patterns of Co-Determined Firms, erscheint in *LABOUR: Review of Labour Economics and Industrial Relations*.

C. Hanck (A4) und M. Demetrescu: Multiple Testing for No Cointegration under Nonstationary Volatility, erscheint in: *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*.

K. Kraft (A5) und J. Lang: Just a question of selection? - The causal effect of profit sharing on a firm's performance, erscheint in: *Industrial Relations*.

J. P. LeSage, C. Vance (A3) und Y. Chih: A Bayesian Heterogeneous Coefficients Spatial Autoregressive Panel Data Model of Retail Fuel Price Rivalry, erscheint in: *Regional Science and Urban Economics*.

J. Lilienthal, R. Fried und A. Schumann (alle B6): Homogeneity testing for skewed and cross-correlated data in regional flood frequency analysis, erscheint in: *Journal of Hydrology*.

C. Neumann und J. Kunert (beide C2): On MSE-optimal crossover designs, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Rafeld, S. Fritz-Morgenthal und P. N. Posch (A7): Behavioural patterns in rogue trading: Analysing the cases of Nick Leeson, Jérôme Kerviel and Kweku Adoboli - Part II, erscheint in: *Journal of Financial Compliance*.

J. Tewes (C1): Block Bootstrap for the Empirical Process of Long-Range Dependent Data, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

R. van Hecke (C1), S. Volgushev und H. Dette (A1, C1, C2): Fourier analysis of serial dependence measures, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

M. Wagner (A3, A4) und D. Wied: Consistent Monitoring of Cointegrating Relationships: The US Housing Market and the Subprime Crisis, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

M. Wagner (A3, A4) und A. Zeileis: Heterogeneity and Spatial Dependence of Regional Growth in the EU: A Recursive Partitioning Approach, erscheint in: *German Economic Review*.

#### Seit dem letzten Infobrief erschienen:

D. Belomestny (C5), W. Härdle und E. Krymova: Sieve estimation of the minimal entropy martingale marginal density with application to pricing kernel estimation, *International Journal of Theoretical and Applied Finance* 20(6), 1-21 (2017).

D. Belomestny (C5) und V. Krätschmer (C5): Optimal Stopping Under Probability Distortions, *Mathematics of Operations Research* 26(2), 1260-1295 (2017).

A. Betken (C3): Change point estimation based on Wilcoxon tests in the presence of long-range dependence, *Electronic Journal of Statistics*, 3633-3672 (2017).

P. Breidenbach, R. Döhrn und C. M. Schmidt (A3): Zeit für Reformen - nicht nur der Steuern, *Wirtschaftsdienst* 97 (6), 395-399 (2017).

A. Bücher (A7), M. Hoffmann (A1), M. Vetter und H. Dette (A1, C1, C2): Nonparametric tests for detecting breaks in the jump behaviour of a time-continuous process, *Bernoulli* 23(2), 1335-1364 (2017).

A. Bücher (A7), P. Kinsvater (B6) und I. Kojadinovic: Detecting breaks in the dependence of multivariate extreme-value distributions, *Extremes* 20(1), 53-89 (2017).

A. Bücher (A7), F. Irresberger und G. Weiß: Testing asymmetry in dependence with copula-coskewness, *North American Actuarial Journal* 21(2), 267-280 (2017).

H. Dehling (C1, C3), B. Franke und J. Woerner (C5): Estimating drift parameters in a fractional Ornstein-Uhlenbeck process with periodic mean, *Statistical Inference for Stochastic Processes* 20, 1-14 (2017).

H. Dehling (C1, C3), A. Rooch (C3) und M. S. Taqqu: Power of Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, *Electronic Journal of Statistics* 11, 2168-2198 (2017).

M. Deistler und M. Wagner (A3, A4): Cointegration in Singular ARMA models, *Economics Letters* 155, 39-42 (2017).

H. Dette, (A1, C1, C2), R. Guchenko und V. B. Melas: Efficient computation of Bayesian optimal discriminating designs, *Journal of Computational and Graphical Statistics* 26(2), 424-433 (2017).

H. Dette, (A1, C1, C2), L. Hoyden, S. Kuhnt und K. Schorning (C1, C2): Optimal designs for thermal spraying, *Journal of the Royal Statistical Society, Ser. C* 66(1), 53-72 (2017).

H. Dette (A1, C1, C2), M. Konstantinou (C2) und A. Zhigljavsky: A new approach to optimal designs for correlated observations, *Annals of Statistics* 45(4), 1579-1608 (2017).

H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und P. Shpilev:  $T$ -optimal discriminating designs for Fourier regression models, *Computational Statistics and Data Analysis* 113, 196-206 (2017).

H. Dette (A1, C1, C2), P. Preuss und K. Sen: Detecting long-range dependence in non-stationary time series, *Electronic Journal of Statistics* 11(1), 1600-1659 (2017).

H. Dette (A1, C1, C2), K. Schorning (C1, C2) und M. Konstantinou (C2): Optimal designs for comparing regression models with correlated observations, *Computational Statistics and Data Analysis* 113, 273-286 (2017).

A. Dürre und R. Fried (beide C3) und D. Vogel: The Spatial Sign Covariance Matrix and its Application for Robust Correlation Estimation, *Austrian Journal of Statistics* 46 (3-4), 13-22 (2017).

R. Fried (C3), S. Abbas, M. Borowski und M. Imhoff: Online analysis of medical time series, *Annual Review of Statistics and Its Application* 4, 169-188 (2017).

K. Friedrichs, N. Bauer, R. Martin und C. Weihs (alle B3): A computational study of auditory models in music recognition tasks for normal-hearing and hearing-impaired listeners, *EURASIP Journal on Audio, Speech, and Music Processing* 2017 (1), 7 (2017).

V. Golosnoy (A1) und N. Parolya: Portfolio Choice for Cooperating Mean-Variance Savers, *Quantitative Finance* 17 (11), 1645-1653 (2017).

M. Hoffmann (A1) und M. Vetter: Weak convergence of the empirical truncated distribution function of the Levy measure of an Ito semimartingale, *Stochastic Processes and their applications* 127(5), 1517-1543 (2017).

Y. Hoga (A4): Change Point Tests for the Tail Index of  $\beta$ -Mixing Random Variables, *Econometric Theory* 33 (4), 915-954 (2017).

Y. Hoga (A4): Testing for Changes in (Extreme) VaR, *Econometrics Journal* 20, 23-51 (2017).

Y. Hoga (A4) und D. Wied: Sequential Monitoring of the Tail Behavior of Dependent Data, *Journal of Statistical Planning & Inference* 182, 29-49 (2017).

Y. Hoga (A4): Monitoring Multivariate Time Series, *Journal of Multivariate Analysis* 155, 105-121 (2017).

P. Kinsvater und R. Fried (B6): Conditional heavy-tail behavior with applications to precipitation and river flow extremes, *Stochastic Environmental Research and Risk Assessment* 31 (5), 1155-1169 (2017).

M. Konstantinou (C2) und H. Dette (A1, C1, C2): Bayesian  $D$ -optimal designs for error-in-variables models, *Applied Stochastic Models in Business and Industry* 33, 269-281 (2017).

W. Krämer (A1), T. Bauer und G. Gigerenzer: Viel Lärm um nichts, oder: Was tun gegen das Innumeratentum, *BIOspektrum* 23 (6), 615 (2017).

W. Krämer (A1): On assessing the relative performance of default predictions, *Journal of Forecasting* 36 (7), 854-858 (2017).

Ch. P. Kustos (B5), A. Leucht und Ch. H. Müller (B5): Tests based on simplicial depth for AR (1) models with explosion, *Journal of Time Series Analysis* 37, 763-784 (2016).

A. Nagathil, C. Weihs, K. Neumann und R. Martin (alle B3): Spectral Complexity Reduction of Music Signals Based on Frequency-domain Reduced-rank Approximations: An Evaluation with Cochlear Implant Listeners, *Journal of the Acoustical Society of America* 142(3), 1219-1228 (2017).

B. Pérez, I. Molina, A. Thieler, R. Fried (C3) und D. Peña: Fast and robust estimators of variance components in the nested error model, *Statistics and Computing* 27 (6), 1655–1675 (2017).

H. Rafeld, S. Fritz-Morgenthal und P. N. Posch (A7): Behavioural patterns in rogue trading: Analysing the cases of Nick Leeson, Jérôme Kerviel and Kweku Adoboli, *Journal of Financial Compliance* 1(2), 156-171 (2017).

C. M. Schmidt (A3) und T. Schmidt: Das Wie entscheidet: Haushaltsüberschüsse sinnvoll verwenden!, *Zeitschrift für Wirtschaftspolitik* 66 (1), 37-49 (2017).

C. M. Schmidt (A3): Geht die Schere zwischen Arm und Reich in Deutschland auseinander? Contra., *WiSt – Wirtschaftswissenschaftliches Studium* 46 (7-8), 43 (2017).

A. Schnurr (C5) und H. Dehling (C1, C3): Testing for Structural Breaks via Ordinal Pattern Dependence, *Journal of the American Statistical Association* 112, 706-720 (2017).

S. Szugat (B5), I. Bakhtin, L. Fechtel, M. Hüscher, J. Riehl, C. Tegethoff und Ch. H. Müller (B4, B5): Bedingungen für hohe Publikationsraten von Ländern in hochrangigen Statistik-Fachzeitschriften, *AStA Wirtschafts- und Sozialstatistisches Archiv* 11(1), 33-49 (2017).

J. Tewes (C1): Change-point tests under local alternatives for long-range dependent processes, *Electronic Journal of Statistics* 11, 2461-2498 (2017).

D. Vogel und M. Wendler (C1): Studentized sequential U-quantiles under dependence with applications to change-point analysis, *Bernoulli* 23, 3114-3144 (2017).

M. Wornowizki, R. Fried (beide C3) und S. G. Meintanis: Fourier Methods for Analysing Piecewise Constant Volatilities, *AStA Advances in Statistical Analysis* 101 (3), 289-308 (2017).

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

J. Heinrich (B5), R. Maurer (B5), S. Hermann (B5), K. Ickstadt (B5) und Ch. H. Müller (B4, B5): Resistance of Prestressed Concrete Structures to Fatigue in Domain of Endurance Limit, In: Hordijk D., Luković M. (eds) High Tech Concrete: Where Technology and Engineering Meet. Springer, Cham. 1784-1792 (2017).

J. Heinrich (B5): Ermüdungsverhalten von Spannbetonbauteilen - Untersuchungen unter sehr hohen Lastwechselzahlen, In: Beiträge zur 5. DAfStb-Jahrestagung mit 58. Forschungskolloquium, 20./21. September 2017, Technische Universität Kaiserslautern, (2017).



J. Heinrich (B5), R. Maurer (B5), S. Hermann (B5) , K. Ickstadt (B5) und Ch. Müller (B4, B5): Resistance of Prestressed Concrete Structures to Fatigue in Domain of Endurance Limit, erscheint in: High Tech Concrete: Where Technology and Engineering Meet, Proceedings to fib Symposium Maastricht 12th - 14th June 2017, (2017).

M. Kansteiner (B4), D. Biermann (B4), M. Dagge (B4), Ch. Müller (B4, B5), M. Ferreira (B4) und W. Tillmann (B1, B4): Statistical Evaluation of the Wear Behaviour of Diamond Impregnated Tools Used for the Core Drilling of Concrete, erscheint in: Proceedings of Euro PM2017, Europe's annual powder metallurgy congress and exhibition, Milan, 1st - 5th October 2017 (2017).

E. Krymova, A. Nagathil, D. Belomestny und R. Martin (alle B3): Segmentation of Music Signals Based on Explained Variance Ratio for Applications in Spectral Complexity Reduction, In: Proc. IEEE International Conference on Acoustics, Speech, and Signal Processing (ICASSP), New Orleans, USA, March 2017.

A. Nagathil, J.-W. Schlattmann, K. Neumann und R. Martin (alle B3): A Feature-based Linear Regression Model for Predicting Perceptual Ratings of Music by Cochlear Implant Listeners, In: Proc. IEEE International Conference on Acoustics, Speech, and Signal Processing (ICASSP), New Orleans, USA, March 2017.

W. Tillmann (B1, B4), D. Biermann (B4), Ch. Müller (B4, B5), S. A. Yonan, M. Ferreira (B4), L. Wojarski, M. Kansteiner (B4) und J. Nellesen: Analysis of the Wear and Micro-crack Behaviour of Single Diamonds during Machining of Concrete, erscheint in Proceedings of Euro PM2017, Europe's annual powder metallurgy congress and exhibition, Milan, 1st - 5th October 2017 (2017).

### 3) Arbeitspapiere

V. Golosnoy (A1), B. Gribisch und M.I. Seifert (A1): Exponential Smoothing of Realized Portfolio Weights, SSRN working paper (2017).

### 4) Populärwissenschaftliche Texte

W. Krämer (A1): Interview mit Peter-Theodor Wilrich, *AStA Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliches Archiv* 11 (1), 50-60 (2017).

W. Krämer (A1): Interview mit Hans Schneeweiß, *AStA Wirtschafts- und Sozialwissenschaftliches Archiv* 11 (2), 135-142 (2017).

### 5) Medienbeiträge

W. Krämer (A1): Teure Umwelt- und Gesundheitspanik. *Frankfurter Allgemeine Zeitung*, 21.08.2017.

## Vorträge

### 1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

W. Krämer (A1): Zur Ökonomie von Panik, Angst und Risiko, HDC-Tagung "Kollektive Angst und Unsicherheit", Würzburg, 23.06.2017.

W. Krämer (A1): Statistik: Entdecker oder Vertuscher von Wahrheit?, Wissenschaftstag des Jungen Kollegs, Akademie der Wissenschaften und der Künste, Düsseldorf, 20.10.2017.

C. M. Schmidt (A3): Normative Herausforderungen sozial- und wirtschaftswissenschaftlicher Forschungsbeiträge zur Klimapolitik, 2. DFG-Rundgespräch Klimawandel, Berlin, 18.09.2017.

### 2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen

E.-C. Becker-Emden (B1): Prediction of Coating Properties with Generalized Linear Models in an HVOF Spraying Process, 17th Annual Conference of the European Network for Business and Industrial Statistics (enbis), Neapel, Italien, 09.-14.09.2017.

A. Betken (C3): Estimation of a change-point in long-range dependent time series based on the Wilcoxon statistic, European Meeting of Statisticians, Helsinki, Finnland, 24.-28. Juli 2017.

A. Bücher (A7): On a Pseudo-Maximum Likelihood Estimator for the Extremal Index, Workshop on Dependence Modeling Tools for Risk Management, Montreal, Kanada, 02.10.-05.10.2017.

A. Bücher (A7): On a Pseudo-Maximum Likelihood Estimator for the Extremal Index, 10th Extreme Value Analysis Conference, Delft, Niederlande, 26.06.-30.06.2017,

J. Chown (C4): Regularization parameter selection by residual based bootstrap, European Meeting of Statisticians, Helsinki University, Finnland, 24.-28.07.2017.

H. Dehling (C1, C3): Two-sample U-statistic processes for long-range dependent data, AMS Spring Sectional Meeting, Bloomington, Indiana, 01.-02.04.2017.

H. Dehling (C1, C3): Change-Point Detection in Time Series using Ordinal Patterns, SSC 2017: Annual Meeting of the Statistical Society of Canada, Winnipeg, 11.-14.06.2017.

H. Dehling (C1, C3): Testing for Structural Breaks via Ordinal Pattern Dependence, European Meeting of Statisticians, Helsinki, 24.-28.07.2017.

H. Dehling (C1, C3): Testing for structural breaks in ordinal pattern dependence, Workshop "Goodness of fit and change-point problems", Bad Herrenalb, 08.-10.09.2017.

H. Dehling (C1, C3): Asymptotic distribution of the two-sample U-statistic process vor long-range dependent data, Workshop "Limit theorems for dependent random variables and applications", Université de Rouen, Frankreich, 09.-10.10.2017.

- A. Dürre (C3): The spatial sign covariance matrix and its application for robust correlation estimation, Statistische Woche, Rostock, 19.–22.9.2017.
- K. Dyballa (A5): The Impact of Disclosure Obligations on Executive Compensation – A Policy Evaluation Using Quantile Treatment Estimators, 29th European Association of Labour Economists (EALE 2017), St. Gallen, Schweiz, 21.–23.09.2017.
- R. Fried (C3): ROBTS - An R-package for robust time series analysis and change-point detection, 3rd Workshop on Goodness-of-fit and Change-point Problems, Bad Herrenalb, 8.–10.9.2017.
- D. Giraud (C3): Invariance principle via orthomartingale approximation, Workshop "Limit theorems for dependent random variables and applications", Université de Rouen, Frankreich, 09.-10.10.2017.
- P. Grabarczyk (A3): The EKC for CO2 Emissions - A Seemingly Unrelated Cointegrating Polynomial Regressions Approach, 40th International Panel Data Conference, University of Macedonia, Thessaloniki, Griechenland, 07.-08.07.2017.
- P. Grabarczyk (A3): Nonparametric Cointegration Analysis of the Environmental Kuznets Curve for Carbon Dioxide Emissions, 2nd Conference on Econometric Models of Climate Change, Nuffield College, University of Oxford, Großbritannien, 04.-05.09.2017.
- C. Hanck (A4): House Prices and Interest Rates? Bayesian Evidence from Germany?, 6th RMSE workshop, Rotterdam, 24.3.2017.
- C. Hanck (A4): Robust Inference under Time-Varying Volatility: A Real-Time Evaluation of Professional Forecasters, Statistische Woche, Rostock, 20.9.2017.
- J. Heinrich (B5): Ermüdungsverhalten von Spannbetonbauteilen - Untersuchungen unter sehr hohen Lastwechselzahlen, 5. DAfStb-Jahrestagung mit 58. Forschungskolloquium, Kaiserslautern, Deutschland, 20.09.2017.
- J. Heinrich (B5): Resistance of Prestressed Concrete Structures to Fatigue in Domain of Endurance Limit, fib Symposium 2017 "High Tech Concrete: Where Technology and Engineering Meet", Maastricht, Niederlande, 12.06.2017.
- M. Hoffmann (A1): Nonparametric estimation of gradual change points in the jump behavior of an Ito semimartingale, 20th European Young Statisticians Meeting, Uppsala University, Schweden, 14-18.08.2017.
- M. Hüsch (A1): Analyzing spatio-temporal dependence of wind power forecast errors, Nachwuchsworkshop der DStatG (Statistische Woche), Rostock, 18.-19.09.2017.
- K. Ickstadt (B5): Stochastic Processes for Bayesian Nonparametrics, Workshop on Recent Developments in Bayesian Theory and Stochastic Processes in Honor of Pietro Muliere, Bocconi University, Mailand, Italien, 12.06.2017.

M. Jakubzik (B5): Asymptotic properties of a minimum distance estimator for self-exciting point processes, Nachwuchsworkshop der DStatG (Statistische Woche), Rostock, 18.-19.09.2017.

M. Kansteiner (B4), D. Biermann (B4), M. Dagge (B4), Ch. Müller (B4, B5), M. Ferreira (B4) und W. Tillmann (B1, B4): Statistical Evaluation of the Wear Behaviour of Diamond Impregnated Tools Used for the Core Drilling of Concrete, EURO PM 2017, International Powder Metallurgy Congress & Exhibition, Mailand, Italien, 01.-05.10.2017.

J. Kellermann (A1): The Effect of Intraday Periodicity on Realized Volatility Measures, 70th European Meeting of the Econometric Society (ESEM), Lissabon, Portugal, 21.-25.08.2018.

W. Krämer (A1): Wozu die Statistical Literacy AG?, Statistische Woche, Rostock, 19.09.2017.

S. Kuhnt (B1): Case Studies on the Optimization of Multiple Responses from Real-Life and Computer Experiments, 17th Annual Conference of the European Network for Business and Industrial Statistics (enbis), Neapel, Italien, 09.-14.09.2017.

J. Kunert (C2): Reflections on the future of design of experiments: Experimental design to validate an analysis, Latest Advances in the Theory and Applications of Design and Analysis of Experiments, Banff, Kanada, 7.-11.8.2017.

J. Kunert (C2): Optimal crossover designs in a model with interactions between treatments and subjects, Joint Conference on Biometrics & Biopharmaceutical Statistics, Wien, Österreich, 28.08. - 01.09.2017.

J. Lilienthal (B6): Regional flood frequency analysis of possibly heterogeneous groups, EVAN, Southampton, 05.-07.09.2017.

R. Maurer (B5): Lebensdauer alternder Brücken prüfen und vorausschauen, Rückbau der Lennetalbrücke, 5. DAfStb-Jahrestagung mit 58. Forschungskolloquium, Deutsch-niederländisches Symposium, Kaiserslautern, 21.09.2017.

R. Maurer (B5): Aktuelle Themen aus dem KIB Innovative und gut gestaltete Entwürfe für Spannbetonbrücken, VSVI-Seminar 2017, Bergisch Gladbach und Münster, 07.02.2017.

Ch. H. Müller (B4, B5): Prediction Intervals for Failure Processes, Workshop on Quality Improvement Methods 2017, Dortmund, 17.06.2017.

Ch. H. Müller (B4, B5): Bayesian Prediction of Crack Growth Based on a Hierarchical Diffusion Model, 10th International Conference on Mathematical Methods in Reliability (MMR 2017), Grenoble, Frankreich, 03.07.2017.

K. Pape (A1): Sequential detection of parameter changes in dynamic conditional correlation models, Statistische Woche, Rostock, 19.09.2017.

R. Shevchenko (C5): Estimation of the Drift Function for Fractional Ornstein-Uhlenbeck Processes with Periodic Mean, Doktorandentreffen der Fachgruppe Stochastik, Kaiserslautern, 02.-04.08.2017.

O. Stypka (A4): Testing for Linear Cointegration against the Alternative of Smooth Transition Cointegration, European Meeting of Statisticians, Helsinki, Finland, 24.-28.07.2017.

W. Tillmann (B1, B4): Analysis of the Wear and Micro-crack Behaviour of Single Diamonds during Machining of Concrete, EURO PM 2017, International Powder Metallurgy Congress & Exhibition, Mailand, Italien, 01.-05.10.2017.

J. Tewes (C1): Change-Point tests and the bootstrap under long-range dependence. European Meeting of Statisticians, Helsinki, 24.-28.07.2017.

M. Wagner (A3, A4): The EKC for CO<sub>2</sub> Emissions - A Seemingly Unrelated Cointegrating Polynomial Regressions Approach, IAAE Annual Conference, Sapporo, Japan, 26.-30.06.2017.

M. Wagner (A3, A4): Standard Fully Modified OLS Estimation of Cointegrating Polynomial Regressions, European Meeting of Statisticians, Helsinki, Finland, 24.-28.07.2017.

J. H. C. Woerner (C5): Inference for oscillating Ornstein-Uhlenbeck processes and applications to electricity markets, DYNSTOCH-Workshop 2017, Siegen, 05.-07.04.2017.

J. H. C. Woerner (C5): Inference for the driving Lévy process of continuous-time moving average processes, European Meeting of Statisticians, Helsinki, Finland, 24.-28.07.2017.

### 3) Vorträge in Fakultätsseminaren

D. Belomestny (B3, C5): Nonparametric density estimation from observations with multiplicative measurement errors, The T.N. Thieve Centre, Aarhus University, Dänemark, 05.10.2017.

D. Belomestny (B3, C5): Statistical inference for McKean-Vlasov Stochastic Differential Equation, Weierstraß-Institut für Angewandte Analysis und Stochastik, Berlin, 01.11.2017.

H. Dehling (C1, C3): Some robust change point tests for time series, Mathematical Statistics Seminar, University of Lund, Schweden, 29.09.2017.

H. Dette (A1, C1, C2): Statistik, Geometrie und Pharmakokinetik, Mathematisches Kolloquium, Otto von Guericke Universität Magdeburg, 02.11.2017.

Y. Hoga (A4): Confidence Intervals for Conditional Tail Risk Measures in ARMA-GARCH Models, Kiel, 29.06.2017.

R. Kawka (A3): Fully Modified OLS Estimation of Cointegrating Relationships in an Integrated Locally Stationary Framework, Queensland University of Technology, Brisbane, Australien, 14.08.2017.

J. Kunert (C2): Statistical tests for the equality of two food-products, Freie Universität Bozen, 09.05.2017.

M. Wagner (A3, A4): The EKC for CO<sub>2</sub> Emissions - A Seemingly Unrelated Cointegrating Polynomial Regressions Approach, Universitat de les Illes Balears, Palma de Mallorca, 19.05.2017.

J. H. C. Woerner (C5). Inference for the driving Lévy process of continuous-time moving average processes, Seminar on Financial and Actuarial Mathematics, München, 08.05.2017.

#### 4) Poster

I. Axt (C3): Robust estimation of the standard deviation under change in the mean, Workshop celebrating Peter Rousseeuw's 60<sup>th</sup> birthday, Leuven, 31.05. – 02.06.2017.

A. Dürre (C3): The spatial sign correlation matrix, Workshop celebrating Peter Rousseeuw's 60th birthday, Leuven, 31.5.–02.06.2017.

K. Ickstadt (B5): Prediction for Stochastic Growth Processes in Fatigue Experiments, 10th International Workshop on Bayesian Inference in Stochastic Processes, Bocconi University, Mailand, Italien, 13.-15.06.2017.

Ch. H. Müller (B4, B5): Prediction Intervals for a Birth Process Based on Data Depth, Workshop Celebrating Peter Rousseeuw's 60th Birthday, Leuven, Belgien, 31.5.-02.06.2017.

A. Nagathil, J.-W. Schlattmann, K. Neumann und R. Martin (alle B3): Evaluation of Spectral Music Complexity Reduction Methods for Cochlear Implant Listeners by Means of a Perceptual Music Quality Prediction Model, Conference on Implantable Auditory Prostheses (CIAP), Lake Tahoe, USA, July 2017.

O. Stypka (A4): Testing for Linear Cointegration against Smooth Transition Cointegration, 3rd Vienna Workshop on High Dimensional Time Series in Macroeconomics and Finance, Wien, Österreich, 08.-09.06.2017.

#### Abschlussarbeiten (Master/Diplom)

M. Arnold (A4): Unit root testing in heteroscedastic panels – Simulation evidence and a robust multiple testing procedure, Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Universität Duisburg-Essen, 24.04.2017.

C. Jahns (A4): Anwendung hybrider ARIMA-ANN und ARIMA-SVM Modelle auf das Hydro-Elektrizitätssystem in Nordeuropa, Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Universität Duisburg-Essen, 25.07.2017.

M. A. Jakubzik (B5, C5): Asymptotische Eigenschaften eines Minimum-Distanz-Schätzers für selbstanregende Punktprozesse, Mathematische Fakultät, TU Dortmund, 10.2.2017.

D. Jarczyk (C1): Minimax-Schätzung unter Speicherrestriktionen, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 29.09.2017.

L. Marquis (B5): Berücksichtigung von a-priori Informationen zur Bayesschen Analyse von Drahtbrüchen in Spannbeton, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 13.06.2017.

A. Marwitz (B5): Vergleich von verschiedenen Klassifikationsverfahren in der Fernerkundung, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 08.03.2017.

M. Stapper (C3): Robust Fitting of INARCH Processes, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 17.05.2017.

S. Tolksdorf (C3): Effizienz nichtparametrischer Strukturbruchtests unter Langzeitabhängigkeit, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 06.10.2017.

C. Scharpenberg (C2): Neue Optimalitätskriterien zur Modellidentifikation, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 06.02.2017.

M. Wiegmann (B6): Bayessche Hochwasserstatistik, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 12.07.2017.

M. Wrenger (A4): Statistical Learning about Stock Return Predictability, Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Universität Duisburg-Essen, 01.06.2017.

## Promotionen

S. Birr (C1): Analyzing dynamic dependencies in time series, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 28.06.2017.

A. Dürre (C3): Robust change-point detection and dependence modeling, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 19.07.2017.

K. Eckle (C4): Inference for qualitative features of a multivariate density, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 29.05.2017.

S. Fischer (B6): Robust estimation methods with application to flood statistics, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 03.08.2017.

P. Grabarczyk (A3): Essays on Cointegrating Polynomial Regressions with Applications to the EKC, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 01.08.2017.

S. Hermann (B5): Bayesian Prediction for Stochastic Models in Reliability, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 21.12.2016.

M. Hoffmann (A1): Nonparametric change-point inference for the jump behaviour of time-continuous processes, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 19.07.2017.

K. Möllenhoff (A1): Equivalence of regression curves, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 20.07.2017.

K. Pape (A1): Sequenzielle Erkennung von Strukturbrüchen in der Varianzstruktur von multivariaten Zeitreihen, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 02.08.2017.

A. Rehage (B1): Ausreißeridentifikation für kategoriale und funktionale Daten im generalisierten linearen Modell, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 09.03.2017.

I. Roslyakova (C2): Modelling thermodynamical properties by segmented nonlinear regression, ICAMS, Ruhr-Universität Bochum, 02.06.2017.

G. Uhrin (A4): In Search of Q: Results on Identification in Structural Vector Autoregressive Models, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 01.08.2017.

## Sonstiges

W. Krämer (A1) hat die Sektion "Statistical Literacy" im Rahmen der Statistischen Woche in Rostock, 19.-22.9.2017, organisiert.

W. Krämer (A1) hat die eingeladene Session zur Finanzökonomie des ökonomischen Ausschusses im Rahmen der Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik in Wien, 03.-06.09.2017, organisiert.

Ch. H. Müller (B4, B5) hat die Sektion "Robust and Nonparametric Statistics" während der Statistischen Woche in Rostock, 19.-22.9.2017, organisiert.

C. M. Schmidt (A3): Teilnehmer der Panel-Diskussion "Europa im 21. Jahrhundert: Welche Zukunft für die Euro-Zone?", Tagung des Vereins für Socialpolitik, Wien, 06.09.2017.

## SFB-Akademie

Am 27. und 28. September 2017 fanden zwei weitere Akademie-Workshops an der TU Dortmund statt. Die Themen waren Karrierestrategien und Bewerbungsstandards in und außerhalb der Wissenschaft. Die Teilnehmerinnen und Teilnehmer lernten in angenehmer Atmosphäre Berufswege zu erschließen und sich in Bewerbungssituationen zu behaupten.

Am 06. Dezember 2017 gibt es an der TU Dortmund den nächsten Workshop, diesmal zum Thema "Wissenschaftliches Schreiben". Im Workshop wird der Prozess des wissenschaftlichen Schreibens von der ersten Idee zum Thema über die Strukturierung und Gliederung des Textes bis zu seiner Fertigstellung beleuchtet.

## SFB-Mitglieder unterwegs

H. Dehling (C1, C3) war vom 19.02. bis 24.02.2017 zu Gast bei Prof. Dalibor Volny an der Université de Rouen, Frankreich.

H. Dehling (C1, C3) war vom 25.03. bis 31.03.2017 zu Gast bei Prof. Murad Taqqu an der Boston University, USA.



R. Kawka (A3) war vom 03.07.-01.09.2017 zu Gast bei Stan Hurn und Adam Clements an der Queensland University of Technology in Brisbane (Australien) zur gemeinsamen Forschung im Bereich der Zeitreihenökonomie.

J. Kunert (C2) war vom 1.3.2017 bis 30.9.2017 Visiting Professor an der Fakultät für Wirtschaftswissenschaften und Management der Freien Universität Bozen, Italien.

## Gäste bei uns

Fumiya Akashi (Department of Pure and Applied Mathematics, Waseda University, Tokyo, Japan): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 18.02.-25.02.2017.

Frederic Alberti (Universität Bayreuth): Vortrag: "Einige Anwendungen der Cauchy Transformierten in der Statistik", 31.07.2017.

Dragi Anevski (Centre for Mathematical Sciences, Lund University with Lund Institute of Technology, Schweden): Vortrag "Order restricted problems in Neutron Scattering", 30.01.-01.02.2017.

Alexander Aue (Department of Statistics, University of California, Davis, USA): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 21.02.-23.02.2017.

Fadoua Balabdaoui-Mohr (Seminar for Statistics, Department of Mathematics, ETH Zürich, Schweiz): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 19.04.-20.04.2017.

Juan Antonio Cuesta Albertos (Departamento de Matemáticas, Facultad de Ciencias, Universidad de Cantabria, Spanien): Vortrag "Almost ordering distributions", 16.10.-18.10.2017.

Manfred Deistler (Institut für Stochastik und Wirtschaftsmathematik, Ökonometrie und Systemtheorie, TU Wien, Österreich): Fakultät Statistik, Technische Universität Dortmund, 16.01.-20.01.2017.

Subhra Sankar Dhar (Indian Institute of Technology, Kanpur, Indien): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 01.06.-30.06.2017.

Bernd Funovits (Department of Political and Economic Studies, University of Helsinki, Finnland): Forschungsaufenthalt und Vortrag zu "Non-Gaussian Time Series Models", 15.01.-19.01.2017.

Davide Giraud (LMRS, CNRS-Universität de Rouen, Frankreich): Forschungsaufenthalt und Vortrag zu "Some deviation and moment inequalities for stationary sequences and random fields", 25.05.-22.06.2017.

Roman Guchenko (St. Petersburg State University, Russland): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 03.05.-31.05.2017.

Marc Hallin (Department of Statistics, Universidad Carlos III de Madrid, Spanien): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 15.02.-17.02.2017 und 27.06.-29.06.2017.

Christian Heinze (Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Lehrstuhl für Ökonometrie, Universität Bielefeld): Vortrag "Estimation of structured transition matrices in high dimensions", 09.05.2017.

Eric Hillebrand (Department of Economics and Business Economics, Aarhus University, Dänemark): Forschungsaufenthalt und Vortrag zu "Phase Changes and Seasonal Warming in Early Instrumental Temperature Records", 23.04.-29.04.2017.

Katy Klauenberg (Physikalisch-Technische Bundesanstalt, Berlin): Vortrag "Sampling for assurance of future reliability - exemplified by utility meter surveillance", 28.03.-29.03.2017.

Johannes Lederer (Department of Statistics, University of Washington, USA): Vortrag "A general framework for uncovering dependence networks", 20.04.-21.04.2017.

Yan Liu, (Department of Applied Mathematics, Waseda University, Japan): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 09.02.-14.02.2017.

Ursula U. Müller (Department of Statistics, Texas A&M University, USA): Forschungsaufenthalt und Vortrag zu "Estimating the error distribution in semiparametric models", 22.05.-25.05.2017.

Katharina Parry (Institute of Fundamental Sciences, Massey University, Palmerston North, Neuseeland): Forschungsaufenthalt und Vortrag zu "Where is this heading - Notable differences in the long-term behaviour between deterministic and stochastic traffic assignment models", 28.08.-01.09.2017.

Eva Riccomagno (Dipartimento di Matematica, Università degli Studi di Genova, Italien): Forschungsaufenthalt und Vortrag zu "Discovering statistical equivalence classes of discrete statistical models using computer algebra", 06.02.-09.02.2017.

Karsten Schweikert (Ökonometrie und Wirtschaftsstatistik, Universität Hohenheim): Vortrag "Testing for Cointegration with SETAR Adjustment in the Presence of Structural Breaks", 10.01.2017.

Leopold Sögner (Institute for Advanced Studies, Wien, Österreich): Vortrag "Fully Modified OLS Estimation of Spatially Correlated Cointegrating Relationships", 29.05.-01.06.2017.

Winfried Stute (Mathematisches Institut, Justus-Liebig-Universität Gießen und Universidad Carlo III de Madrid, Spanien): Vortrag "Sich selbst erzeugende Punktprozesse und ihre Anwendungen in der Marktforschung", 06.06.-07.06.2017.

Martin Wendler (Institut für Mathematik und Informatik, Ernst Moritz Arndt Universität Greifswald): Vortrag "Strukturbruchererkennung für Zeitreihen jenseits parametrischer Annahmen", 02.08.-04.08.2017.

Anatoly Zhigljavsky (Mathematics Institute, Cardiff University, Großbritannien): Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 14.03.-17.03.2017.

## Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

### **15<sup>th</sup> Workshop on Quality Improvement Methods,**

16.06.-17.06.2017, Hotel Esplanade, Dortmund.

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

<https://www.statistik.tu-dortmund.de/qim15.html>

Bei dem Workshop gab es 12 Vortragende aus 7 Ländern, die zu folgenden Themen vortrugen: Versuchsplanung, Zuverlässigkeitstheorie, Zuverlässigkeit von Batterien, Vorhersage von Ausfällen, Kontrollkarten und Unsicherheiten im Produktionsprozess, Optimierung im Produktionsprozess.



Teilnehmer Workshop on Quality Improvement Methods, 2017

### **Advances in financial and time series econometrics**

08.10.-10.10.2017, Kloster Drübeck, Harz.

Organisation: M. Große (Z), W. Krämer (A1).

<https://www.statistik.tu-dortmund.de/2421.html>

Zum vierten Mal insgesamt und zum dritten Mal im romantischen Kloster Drübeck im Harz, trafen sich Projektleiter und Mitarbeiter unseres SFBs und der aus dem befreundeten Berliner SFB "Ökonomisches Risiko" hervorgegangenen Arbeitsgruppe um Prof. Dr. W. Härdle zwecks Austausch von Forschungsergebnissen und gegenseitiger Stimulation. Themenschwerpunkt war wie immer die empirische

Finanzökonomie, aber auch statistische Probleme des Wetters und des Arbeitsmarktes kamen vor. Zu jedem der insgesamt 19 Vorträge gab es einen offiziellen Diskutanten von der jeweils anderen Universität. Am Schluss war man sich einig: 2019 wird dieses schöne Treffen wiederholt.



Teilnehmer Workshop: Advances in financial and time series econometrics, 2017

Kommt noch:

**7<sup>th</sup> Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series**

16.11.-17.11.2017, EIEF-Einaudi Institute for Economics and Finance, Rom.

Organisation: H. Dette (A1, C1, C2, T1) et al.

<http://www.eief.it/files/2017/09/new-developments-in-econometrics-and-time-series.pdf>

**16<sup>th</sup> Workshop on Quality Improvement Methods,**

1.06.-2.06.2018, Hotel Esplanade, Dortmund.

Organisation: S. Kuhnt (B1), J. Kunert (C2), Ch. H. Müller (B4, B5), N. Malevich (B4), K. Leckey (B5).



## Diskussionspapiere

- 19/17 P. Bagchi und H. Dette (A1, C1): A test for separability in covariance operators of random surfaces.
- 18/17 H. Dette (A1, C1), K. Kokot (A1, C1) und A. Aue: Functional data analysis in the Banach space of continuous functions.
- 17/17 K. Schorning (C2), H. Dette (C2), K. Kettelhake und T. Möller: Optimal designs for enzyme inhibition kinetic models.
- 16/17 A. Bücher (A7), J.-D. Fermanian und I. Kojadinovic: Combining cumulative sum change-point detection tests for assessing the stationarity of univariate time series.
- 15/17 A. van Delft, P. Bagchi (A1, C1), V. Characiejus und H. Dette (A1, C1): A nonparametric test for stationarity in functional time series.
- 14/17 M. Andor und K. Fels: Behavioral economics and energy conservation - a systematic review of non-price interventions and their causal effects.
- 13/17 A. Bücher (A7) und I. Kojadinovic: A note on conditional versus joint unconditional weak convergence in bootstrap consistency results.
- 12/17 A. Bücher (A7) und J. Segers: Inference for heavy tailed stationary time series based on sliding blocks.
- 11/17 M. Frondel (A3), O. Kutzschbauch, S. Sommer und S. Traub: Die Gerechtigkeitslücke in der Verteilung der Kosten der Energiewende auf die privaten Haushalte.
- 10/17 E. Naevdal und M. Wagner (A3, A4): The speed of transition revisited.
- 9/17 M. Andor (A3), M. Frondel (A3) und M. Horvath: Consequentiality and the willingness-to-pay for renewables: Evidence from Germany.
- 8/17 H. Dette und J. Gösmann (beide A1, C1): Relevant change points in high dimensional time series.
- 7/17 K. Pape (A1), P. Galeano und D. Wied: Sequential detection of parameter changes in dynamic conditional correlation models.
- 6/17 R. Van Hecke (A1, C1), S. Volgushev und H. Dette (A1, C1): Fourier analysis of serial dependence measures.
- 5/17 M. Deistler und M. Wagner (A3, A4): Cointegration in singular ARMA models.
- 4/17: M. Andor (A3), Ch. M. Schmidt (A3), S. Sommer: Climate change, population ageing and public spending: Evidence on individual preferences.
- 3/17 F. Lucka, K. Proksch, Ch. Brune, N. Bissantz (C4), M. Burger, H. Dette (A1, C1) und F. Wübbeling: Risk estimators for choosing

- regularization parameters in ill-posed problems - properties and limitations.
- 2/17 C. Gerstenberger (C3): Robust estimation of change-point location.
- 1/17 Ch. Neumann und J. Kunert (beide C2): On MSE-optimal crossover designs.
- 88/16 S. Fischer (B6), A. Schumann (B6) und Alexander Schnurr: Ordinal pattern dependence between hydrological time series.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:  
<http://www.statistik.tu-dortmund.de/sfb823-dp.html>