

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

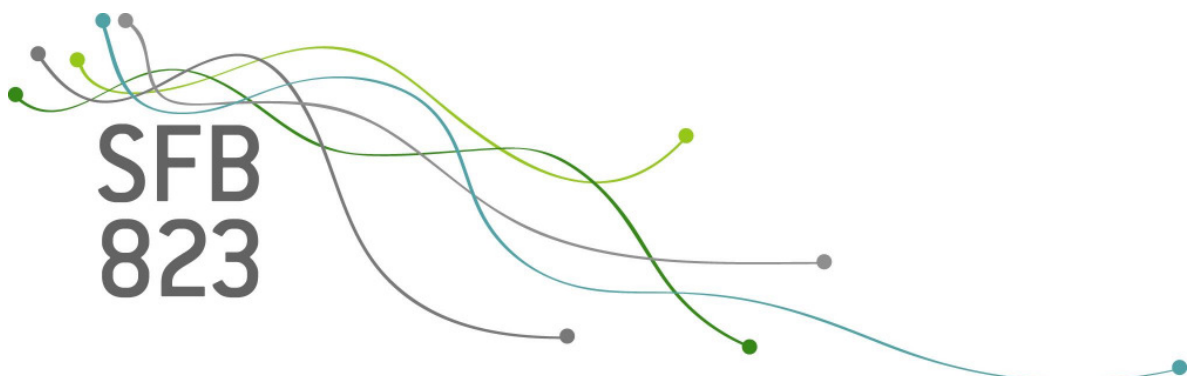
Ausgabe 3

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, Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter, Projektleiterinnen und Projektleiter unseres schönen SFBs,

erstmal wünsche ich Ihnen allen ein geruhsames Weihnachtsfest! Wenn es Ihnen so geht wie mir, dann brauchen Sie jetzt dringend ein paar Tage, um von der Hektik des vergangenen Jahres Abstand zu nehmen.

Hektik heißt aber auch: Es tut sich was. Wie Sie auf den folgenden Seiten sehen, hat unser SFB nunmehr volle Fahrt aufgenommen, sind SFB-Beteiligte in fast allen Kontinenten dieser Erde unterwegs und umgekehrt bei uns in Dortmund oder Bochum Gäste aus aller Herren Länder zu gemeinsamen Arbeiten präsent. Und



auch die bisherige Liste unserer Diskussionspapiere und vor allem unsere bereits erschienenen wissenschaftlichen Arbeiten kann sich wirklich sehen lassen, (auch wenn sie durchaus etwas ausgeglichener aussehen könnte - einige Projekte halten sich bisher noch etwas zurück...); sie plaziert uns, wenn ich die Erfahrungen meiner fünf Dienstjahre im zuständigen Bewilligungsausschuss der DFG einmal extrapoliere, in die Spitzengruppe

aller deutschen SFBs. Also bitte, bitte, bitte: Im nächsten Jahr nicht nachlassen, sondern weiter so!

Und dann begrüßen wir als SFB-823-Ehrenmitglied Fräulein Amalia Anna Große – hier mit Bild – gerade drei Monate alt. Liebe Frau Wübbold, herzlichen Glückwunsch, auch im Namen aller anderen SFB-Beteiligten, für Ihr allerliebstes Töchterlein!

Walter Krämer
TU Dortmund
Sprecher des SFB 823

Ehrungen und Preise

C. Vance und **M. Frondel (beide A3)** haben den 2. Publikationspreis 2009 der Gesellschaft der Freunde und Förderer des RWI für den in *Environmental and Resource Economics* erschienen Artikel "Do High Oil Prices Matter? Evidence on the Mobility Behavior of German Households" erhalten.

W. Leininger (A5) hat für die Veranstaltung "Preis- und Allokationstheorie" den Lehrpreis 2009 der Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Fakultät der TU Dortmund erhalten.

Y. Gu (A5) hat den Dissertationspreis 2010 der Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Fakultät der TU Dortmund erhalten.

R. Martin (B3) wurde für seine Entwicklungen auf dem Gebiet der "Geräuschreduktion für Hörgeräte" in Zusammenarbeit mit der Firma Siemens mit dem Transferpreis der RUBITEC ausgezeichnet.

R. Martin (B3) wurde vom Institute of Electrical and Electronics Engineers (IEEE), der weltweit größte technische Fachverband, zum Fellow gewählt.

Ph. Preuß (C1) hat den "Preis für Studierende" der Ruhr-Universität Bochum für seine Masterarbeit (M.Sc.) "Stationarität in lokal-stationären Zeitreihen" erhalten.

Ganz herzliche Glückwünsche an alle Preisträger und Geehrten!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

I. Ben Khediri, C. Weihs (B3, B4, C2) und M. Limam (2010): Support Vector Regression control charts for multivariate nonlinear autocorrelated processes, erscheint in: *Chemometrics and Intelligent Laboratory Systems*.

doi: 10.1016/j.chemolab.2010.05.021

M. Birke, N. Bissantz (beide C4), H. Holzmann: Confidence bands for inverse regression models - with application to gel electrophoresis, erscheint in: *Inverse Problems*.

L. Davies, C. Höhenrieder und W. Krämer (A1, A4): Recursive estimation of piecewise constant volatilities, erscheint in: *Computational Statistics and Data Analysis*.

H. Dette (A1, C1, C2), M. Birke (C4) and K. Stahljans: Testing symmetry of a non-parametric bivariate regression function, erscheint in: *Journal of Nonparametric Statistics*.

H. Dette (A1, C1, C2), T. Holland-Letz and A. Pepelyshev: A geometric characterization of optimal designs for regression models with correlated observations, erscheint in: *Journal of the Royal Statistical Society, Ser. B*.

H. Dette (A1, C1, C2), T. Kinsvater and M. Vetter (A1): Testing nonparametric hypotheses for stationary processes by estimating minimal distances, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas and P. Shpilev: Optimal designs for estimating the slope in nonlinear regression, erscheint in: *Statistica Sinica*.

H. Dette (A1, C1, C2), J. Wagener and S. Volgushev (C1): Comparing conditional quantile curves, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

J. Franke (A5): "The Incentive Effects of Leveling the Playing Field – An Empirical Analysis of Amateur Golf Tournaments", erscheint in: *Applied Economics*.

Y. Gu (A5) und T. Wenzel: Transparency, Price-Dependent Demand and Product Variety, erscheint in: *Economics Letters*.

M. Hallin (C1), D. Cassart und D. Paindaveine: A class of optimal tests for symmetry based on Edgeworth approximations, erscheint in: *Bernoulli*.

M. Hallin (C1), J. Hirukawa, H. Taniai und M. Taniguchi: Rank-based inference for multivariate nonlinear and long-memory time series models, erscheint in: *Journal of the Japan Statistical Society*.

M. Hallin (C1) und C. Ley: Skew-symmetric distributions and Fisher information: A tale of two densities, erscheint in: *Bernoulli*.

M. Hallin (C1), Ch. Mathias, H. Pirotte und D. Veredas: Market liquidity as dynamic factors, erscheint in: *Journal of Econometrics*, special issue on Factor Models.

M. Hallin (C1), T. Shiohama, D. Veredas und M. Taniguchi: Dynamic portfolio optimization using generalized dynamic conditional heteroskedastic factor models, erscheint in: *Journal of the Japan Statistical Society*.

M. Hallin (C1), Y. Swan, T. Verdebout und D. Veredas: Rank-based testing in linear models with stable errors, erscheint in: *Journal of Nonparametric Statistics*.

C. Hanck und W. Krämer (A1, A4): The exact bias of s^2 in linear panel regressions with spatial autocorrelation, erscheint in: *Economics Letters*.

W. Krämer (A1, A4) und G. Arminger: 'True believers' or: Numerical terrorism at the nuclear power plant, erscheint in: *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik*.

W. Krämer und M. van Kampen (beide A1): A simple nonparametric test for structural change in joint tail probabilities, erscheint in: *Economics Letters*.

J. Kunert (C2) und S. Mersmann: Optimal designs for an interference model, erscheint in: *Journal of Statistical Planning and Inference*.

S. P. Luque, R. Fried (C3): Recursive filtering for zero offset correction of diving depth time series with GNU R package divemove, erscheint in: *PLoS ONE*.

A. Schabert (A4): Monetary policy under a fiscal theory of sovereign default, erscheint in: *Journal of Economic Theory*.

C. M. Schmidt und H. Tauchmann (A3): Heterogeneity in the Intergenerational Transmission of Alcohol Consumption: A quantile Regression Approach, erscheint in: *Journal of Health Economics*.

doi: 10.1016/j.jhealeco.2010.09.005.

C. Weihs (B3, B4, C2), A. Messaoud und N. Raabe: Control Charts Based on Models Derived from Differential Equations, erscheint in: *Quality and Reliability Engineering International*.

doi: 10.1002/qre.1134

bereits erschienen:

H. Dehling (C3, C5), B. Franke (C5) und T. Kott (C5): Drift Estimation for a Periodic Mean Reversion Process, *Statistical Inference for Stochastic Processes* 13, 2010, 175-192.

- H. Dette (A1, C1, C2) und A. Bücher (A1): A note on bootstrap approximations for the empirical copula process, *Statistics and Probability Letters* 80, 2010, 1925-1932.
- H. Dette (A1, C1, C2), M. Gühlich und J. Nagel: Random block matrices generalizing the classical Jacobi and Laguerre ensembles, *Journal of Multivariate Analysis* 101, 2010, 1884-1897.
- H. Dette (A1, C1, C2), C. Kiss (C2), M. Bevanda und F. Bretz: Optimal designs for the EMAX, log-linear and exponential models, *Biometrika* 97 (2), 2010, 513-518.
- H. Dette (A1, C1, C2), C. Kiss (C2) und W. K. Wong: A web-based tool for finding optimal designs for the Michaelis-Menten model and an overview, *Statistics in Biopharmaceutical Research* 2 (3), 2010, 383-393.
- H. Dette (A1, C1, C2) und M. Marchlewski (C1): A robust test for homoscedasticity in nonparametric regression, *Journal of Nonparametric Statistics* 22 (6), 2010, 723-736.
- H. Dette (A1, C1, C2) und V. B. Melas: A note on some extremal problems for trigonometric polynomials, *International Journal of Modern Mathematics* 5 (1), 2010, 11-30.
- H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und P. Shpilev: Optimal designs for trigonometric regression models, *Journal of Statistical Planning and Inference* 141, 2011, 1343-1353.
- H. Dette (A1, C1, C2) und A. Pepelyshev: NPUA: A new approach for the analysis of computer experiments, *Chemometrics and Intelligent Laboratory Systems* 104, 2010, 333-340.
- H. Dette (A1, C1, C2) und A. Pepelyshev: Generalized Latin hypercube design for computer experiments, *Technometrics* 52 (4), 2010, 421-429.
- 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, *Annals of Applied Statistics* 4 (3), 2010, 1430-1450.
- H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev, P. Shpilev und W. K. Wong: Optimal designs for discriminating between dose-response models in toxicology studies, *Bernoulli* 16 (4), 2010, 1164-1176.
- H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: A new approach to optimal design for linear models with correlated observations, *Journal of the American Statistical Association* 105 (491), 2010, 1093-1103.
- W. C. Emmens, G. Sebastiani (B2) und A. H. van den Boogaard: The technology of Incremental Sheet Forming - A brief review of the history, *Journal of Materials Processing Technology* 210, 2010, 981-997.
- M. Erdbrügge und C. Auer (B2): Generalized linear models and transformations for unreplicated factorial experiments in the presence of dispersion effects, *Journal of Statistical Planning and Inference* 140, 2010, 9-19.

- D. Ferger und D. Vogel (C3): Weak Convergence of the Empirical Process and the Rescaled Empirical Distribution Function in the Skorokhod Product Space, *Theory of Probability and its Applications* 54 (4), 2010, 609-625.
- B. Franke (C5): Limit theorems for a recursive maximum process with location-dependent periodic intensity-parameter, *Extremes*, 2010.
veröffentlicht online: DOI 10.1007/s10687-010-0106-6.
- B. Franke (C5) und T. Saigo: A selfsimilar process arising from a random walk with random environment in random scenery, *Bernoulli* 16 (3), 2010, 825-857.
- M. Hallin (C1), D. Paindaveine und Th. Verdebout: Testing for common principal components under heterokurticity, *Journal of Nonparametric Statistics* 22, 2010, 879-895.
- M. Hallin (C1), D. Paindaveine und Th. Verdebout: Optimal rank-based testing for principal components, *Annals of Statistics* 38, 2010, 3245-3299.
- C. Jeleazcov, L. Krajinovic, T. Münster, T. Birkholz, R. Fried (C3), J. Schüttler und J. Fechner: Validation of a new continuous non-invasive technique of arterial blood pressure monitoring (CNAPTM) during surgical anesthesia, *British Journal of Anaesthesia* 105, 2010, 264-272.
- C. Marek, N. Bissantz (C4), E. Curio, A. Siegert, B. Tacud und D. Ziggel: Spatial orientation of the Philippine bent-toed gecko (*Cyrtodactylus philippinus*) in relation to its home range, *Salamandra* 46, 2010, 93-97.
- A. F. Norjigitov und O. Sh. Sharipov (C3): Central limit theorem for weakly dependent random variables with values in $D[0;1]$, *Uzbek Mathematical Journal*, 2010 (2), 103-112.
- H. Riazoshams, H. Midi und O. Sh. Sharipov (C3): The performance of robust two stage estimator in nonlinear regression with autocorrelated error, *Communications in Statistics-Simulation and Computation* 39 (6), 2010, 1251-1268.
- S. H. Richter, J. P. Garner, C. Auer, J. Kunert (beide C2) und H. Würbel: Systematic variation improves reproducibility of animal experiments, *Nature Methods* 7, 2010, 167-168.
- Y. Rozenholc, T. Mildenerger und U. Gather (beide C1): Combining Regular and Irregular Histograms by Penalized Likelihood, *Computational Statistics and Data Analysis* 54, 2010, 3313-3323.
- O. Sailer (C2): An exact upper limit for the variance bias in a carry-over model with correlated errors, *Journal of Statistical Planning and Inference* 140, 2010, 2057-2068.
- A. Schabert und L. Linnemann (beide A4): Debt Non-neutrality, Policy Interactions, and Macroeconomic Stability, *International Economic Review* 51 (2), 2010, 461-474.
- K. Schettlinger, R. Fried (C3) und U. Gather (C1): Real Time Signal Processing by Adaptive Repeated Median Filters, *International Journal of Adaptive Control and Signal Processing* 24 (5), 2010, 346-362.

W. Tillmann, E. Vogli, I. Baumann, G. Kopp und C. Weihs (alle B4): Desirability-Based Multi-Criteria Optimization of HVOF Spray Experiments to Manufacture Fine Structured Wear-Resistant 75Cr3C2-25(NiCr20) Coatings, *Journal of Thermal Spray Technology* 19, 2010, 392-408.

2) Veröffentlichungen in Sammelbänden (nur bereits erschienene)

I. Berkes und H. Dehling (C3, C5): Dependence in Probability, Analysis and Number Theory: The Mathematical Work of Walter Philipp (1936–2006), in: I. Berkes, R. Bradley, H. Dehling, M. Peligrad, R. Tichy (Hrsg.): Dependence in Probability, Analysis and Number Theory, Kendrick Press, 2010, 1-19.

M. Bücker, G. Szepannek und C. Weihs (B3, B4, C2): Local Classification of Discrete Variables by Latent Class Models, in: H. Locarek-Junge und C. Weihs (Hrsg.), Classification as a Tool for Research, Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization, 127-135, 2010, Springer.

H. Dehling (C3, C5): Almost Sure Convergence of Random Variables, in: M. Lovric (Hrsg.): International Encyclopedia of Statistical Science, 2011, Springer.

H. Dehling (C3, C5) und M. Wendler (C3): Law of the iterated logarithm for U-statistics of weakly dependent observations, in: I. Berkes, R. Bradley, H. Dehling, M. Peligrad, R. Tichy (Hrsg.): Dependence in Probability, Analysis and Number Theory, Kendrick Press, 2010, 177-194.

H. El Saied und R. Fried (C3): Robust estimation of INARCH models, with a special focus on small means, in: Y. Lechevallier, G. Saporta (Hrsg.): Proceedings von COMPSTAT 2010, 2010, 967-974.

T. Gerkmann, R. Martin (beide B3): Cepstral smoothing with reduced computational complexity, 9. ITG-Fachtagung Sprachkommunikation, Oct. 2010.

T. Gerkmann, R. Martin (beide B3): Empirical distributions of DFT-domain speech coefficients based on estimated speech variances, International Workshop on Acoustic Echo and Noise Control (IWAENC), Tel Aviv, Israel, Aug. 2010.

M. Hallin (C1), D. Cassart und D. Paindaveine: On the estimation of cross-information quantities in R-estimation, in J. Antoch, M. Husková und P.K. Sen (Hrsg.): Nonparametrics and Robustness in Modern Statistical Inference and Time Series Analysis: A Festschrift in Honor of Professor Jana Jurecková, I.M.S. Collections, 2010, 35-45.

M. Hallin (C1): On the non Gaussian asymptotics of the likelihood ratio test statistic for homogeneity of covariance, in: D. Hunter, D. Richards, and J. L. Rosenberger (Hrsg.): Nonparametric Statistics and Mixture Models: A Festschrift in Honor of Thomas P. Hettmansperger, World Scientific, 2010, Singapore, 162-173.

E. Al Kaysi, R. Unland, C. Weihs (B3, B4, C2) und C. Branki: Medical Optimal Decision Making based Holonic Multi Agent System, in: Proceedings of the IEEE 2010, The 2nd International Conference on Computer and Automation Engineering (ICCAE), IEEE Press, Vol. 3, 392-396, 2010, Singapur.

- G. Kopp, I. Baumann, E. Vogli, W. Tillmann und C. Weihs (alle B4): Desirability-Based Multi-Criteria Optimisation of HVOF Spray Experiments, in: H. Locarek-Junge und C. Weihs (Hrsg.), Classification as a Tool for Research, Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization, 811-818, 2010, Springer.
- W. Krämer (A1, A4): The Durbin-Watson-Test, in: M. Lovric (Hrsg.), International Encyclopedia of Statistical Sciences, 2011, Springer.
- W. Krämer (A1, A4): Statistical Fallacies, in: M. Lovric (Hrsg.), International Encyclopedia of Statistical Sciences, 2011, Springer.
- D. Mauler, R. Martin (B3): Optimization of Switchable Windows for Low-Delay Spectral Analysis-Synthesis, IEEE International Conference on Acoustics, Speech, and Signal Processing (ICASSP), March 2010.
- S. Mostaghim, H. Trautmann und O. Mersmann (2010): Preference-Based Multi-Objective Particle Swarm Optimization Using Desirabilities, in: R. Schaefer et al.: 11th International Conference on Parallel Problem Solving from Nature (PPSN), LNCS 6239, Springer, 101-110.
- T. Müller, J. Schiffner (C2), H. Schwender, G. Szepannek, C. Weihs (C2) und K. Ickstadt: Local analysis of SNP data, in: H. Locarek-Junge und C. Weihs (Hrsg.), Classification as a Tool for Research, Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization, 473-480, 2010, Springer.
- A. Nagathil, T. Gerkmann und R. Martin (alle B3): Musical Genre Classification Based on a Highly-resolved Cepstral Modulation Spectrum, in Proceedings EURASIP European Signal Processing Conference (EUSIPCO), 462-466, 2010.
- A. Nagathil, T. Gerkmann und R. Martin (alle B3): Cepstral Modulation Features for Classifying Audio Data, in Proceedings 36. Jahrestagung für Akustik (DAGA), March 2010.
- A. Nagathil (B3), I. Vatolkin und W. Theimer: Comparison of Partition-Based Audio Features for Music Classification, 9. ITG-Fachtagung Sprachkommunikation, Oct. 2010.
- N. Raabe, D. Enk, D. Biermann und C. Weihs, (alle B4): Dynamic disturbances of BTO deep-hole drilling: Modelling chatter and spiralling as regenerative effects, in: A. Fink, B. Lausen, W. Seidel, A. Ultsch (Hrsg.), Advances in Data Analysis, Data Handling and Business Intelligence, 745-754, 2010, Springer.
- J. Schiffner (C2), G. Szepannek, T. Monthé und C. Weihs (C2): Localized logistic regression for categorical influential factors, in: A. Fink, B. Lausen, W. Seidel, A. Ultsch (Hrsg.), Advances in Data Analysis, Data Handling and Business Intelligence, 185-195, 2010, Springer.
- O. Sh. Sharipov (C3): Glivenko-Cantelli theorems, in: M. Lovric (Hrsg.): International Encyclopedia of Statistical Science, 2011, Springer.
- O. Sh. Sharipov und M. Wendler (beide C3): Bootstrap for the sample mean and for U-statistics of weakly dependent observations, Proceedings of the 3rd International

Conference Problems of Cybernetics and Informatics, 06.-08.09.2010, Baku, Azerbaijan, Vol. II, 205–208.

K. Sommer und C. Weihs (B3): Analysis of polyphonic music time series, in: A. Fink, B. Lausen, W. Seidel, A. Ultsch (Hrsg.), *Advances in Data Analysis, Data Handling and Business Intelligence*, 429-437, 2010, Springer.

G. Szepannek, M. Gruhne, B. Bischl, S. Krey, T. Harczos, F. Klefenz, C. Dittmar, C. Weihs (B3): Perceptually Based Phonem Recognition in Popular Music, in: H. Locarek-Junge und C. Weihs (Hrsg.), *Classification as a Tool for Research, Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization*, 751-758, 2010, Springer.

D. Vogel (C3), A. Dürre und R. Fried (C3): Elliptical graphical modeling in higher dimensions, in: N. Wessel (Hrsg.), *Proceedings of International Biosignal Processing Conference*, 14.-16.07.2010, Berlin, 17, 2010, 1-4.

T. Wagner und H. Trautmann (2010): Integration of Preferences in Hypervolume-Based Multi-Objective Evolutionary Algorithms by Means of Desirability Functions, *Special Issue: Preference-based Multiobjective Evolutionary Algorithms*, *IEEE Transactions on Evolutionary Computation* 14 (5), 688–701.

C. Weihs (B3, B4, C2), O. Mersmann, B. Bischl, A. Fritsch, H. Trautmann (B4), T. M. Karbach und B. Spaan: A Case Study on the Use of Statistical Classification Methods in Particle Physics, *Proceedings of the Second Meeting on Statistics and Data Mining, MSDM'2010*, Hammamet, Tunisia, 2010, 1-7.

<http://tasa-online.org/proceedings-msdm2010.pdf>

3) Monographien (nur bereits erschienene)

I. Berkes, R. Bradley, H. Dehling (C3, C5), M. Peligrad und R. Tichy (Hrsg.): *Dependence in Probability, Analysis and Number Theory*, Kendrick Press, Heber City 2010, ISBN 0-9793183-8-6.

H. Grohmann, W. Krämer (A1, A4), A. Steger (Hrsg.): *Statistik in Deutschland - 100 Jahre Deutsche Statistische Gesellschaft*, 2011, Springer, ISBN 978-3-642-15634-2.

4) Sonstige Veröffentlichungen (nur bereits erschienene)

A. Schabert (A4): *Optimal Central Bank Lending*, *Tinbergen Institute Discussion Paper TI 2010-057/2*.

Patente

G. Sebastiani, P. Schmelzer, M. Marré, M. Trompeter, A. Brosius und A. E. Tekkaya (alle B2): Verfahren zur Herstellung von Verbundwerkstücken mit Verstärkungsstrukturen sowie entsprechend hergestellte Verbundwerkstücke, Internationale Patentanmeldung der Technischen Universität Dortmund, PCT/DE2010/000619, Anmeldedatum: 27.05.2010.

Vorträge

1) eingeladene Vorträge auf Konferenzen:

M. Birke (C4): Testing for symmetry in inverse regression problems, 28th European Meeting of Statisticians 2010, 17.-23.08.2010, Piräus.

H. Dehling (C3, C5): Asymptotic Distribution of two-sample empirical U-quantiles for dependent data, Conference on Limit Theorems for Dependent Data and Applications, La Sorbonne, 21.-23.06.2010, Paris.

H. Dette (A1, C1, C2): Shape Restrictions in Non- and Semiparametric Estimation of Econometric Models, 05.-06.11.2010, Evanston.

H. Dette (A1, C1, C2): Borrowing strength theory powering applications - A conference in honor of Larry Brown's 70th birthday, 15.-17.12.2010, Philadelphia.

H. Dette (A1, C1, C2) and T. Kiss (C2): Recent developments in designing experiments for dose finding studies, 25th International Biometric Conference, 05.-10.12.2010, Florianópolis.

R. Fried (C3): Robust Monitoring of Time Series, European Meeting of Statisticians, 16.-22.08.2010, Piräus.

R. Fried (C3): Outliers and Robustness in INGARCH Models, Workshop on Integer Valued Time Series, 30.09.-01.10.2010, Kaiserslautern.

R. Fried (C3): Robust Online Monitoring, ERCIM Workshop, 10.-13.12.2010, London.

M. Hallin (C1): Régression quantile spatiale localement linéaire, 42nd Journées de Statistique, Annual Meeting of the Société Française de Statistique, 25.-28.05.2010, Marseille.

M. Hallin (C1): From multiple-output quantiles to signed ranks: a new multivariate probability integral transformation, Joint Statistical Meetings, 31.07.-05.08.2010, Vancouver.

M. Hallin (C1): On the estimation of cross-information quantities, Prague Asymptotics, 30.08.-03.09.2010, Prag.

M. Hallin (C1): Multivariate quantiles: from L1 optimization to halfspace depth and local linear quantile regression, Workshop on "Time Series, Quantile Regression and Model Choice", Technische Universität Dortmund, 20.-21.09.2010.

M. Hallin (C1): 'Rank-based tests for unit roots' und 'Local bilinear multiple-output quantile regression', 3rd International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, University of London and LSE, 10.-12.12.2010, London.

M. Hallin (C1): 'The unrestricted generalized dynamic factor model' und 'Rank-based testing and estimation in the general linear model with stable errors', 4th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics, University of London and LSE, 10.-12.12.2010, London.

W. Krämer (A1): Strukturbruchtests bei Renditekorrelationen, Statistische Woche, 14.-17.09.2010, Nürnberg.

D. Vogel (C3): Elliptical graphical modelling in higher dimensions, International Biosignal Processing Conference, Humboldt-Universität zu Berlin, 14.– 16.07.2010.

C. Weihs (B3): Software in Music Information Retrieval (MIR); 34. GfKI-Jahrestagung Karlsruhe, 21.-23.07.2010.

J. Woerner (C5): Fractional Lévy processes: capturing stylized facts of empirical data, 6th International Conference on Lévy Processes: Theory and Applications, 26.07.-30.07.2010, Dresden.

J. Woerner (C5): Modellierung zufälliger Phänomene, Sommerakademie La Villa der Studienstiftung des deutschen Volkes, 07.09.2010, La Villa.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen und Fakultätsseminaren:

M. Birke (C4): Testing for Monotonicity using Monotone Rearrangements, Université Catholique de Louvain, 21.05.2010.

B. Bischl (B3): Selecting Groups of Audio Features by Statistical Tests and the Group Lasso, ITG-Speech, 06.-08.10.2010, Bochum.

M. Borowski (C1): Data-driven window width adaption for robust online moving window regression, COMPSTAT 2010, 22.-27.08.2010, Paris.

H. Dehling (C3, C5): New Techniques for Empirical Processes of Dependent Data, Seminar on Probability and its Applications, Penn State University, State College, 27.08.2010, Pennsylvania.

H. Dehling (C3, C5): Asymptotic Distribution of Two-Sample Quantiles of Dependent Data, Statistics and Probability Seminar, Boston University, 05.10.2010, Boston.

H. Dette (A1, C1, C2): Non-crossing quantile curves, Johannes Kepler Universität Linz, 14.10.2010 (außerdem gehalten: Universität Mannheim, 29.11.2010).

H. Dette (A1, C1, C2): Geometric construction of optimal designs for pharmacokinetic models, Department of Statistics, University of Valladolid, 08.10.2010.

M. Eichhoff (B3): Musical Instrument Detection based on Extended Feature Analysis, GfKI - CLADAG Conference 2010, 08.-10.09.2010, Florenz.

H. El-Saied (C3): M-Estimation of INARCH Models, with a special focus on small means, 19th Conference on Computational Statistics COMPSTAT 2010, 22.-27.08.2010, Paris.

J. Franke (A5): Leveling the Lobbying Process: Effort Maximization in Asymmetric N-Person Contests, Annual Meeting of the Association for Public Economic Theory, 25.-27.06.2010, Istanbul.

J. Franke (A5): The Incentive Effects of Leveling the Playing Field – An Empirical Analysis of Amateur Golf Tournaments, International Conference on Panel Data, 02.-04.07.2010, Amsterdam.

J. Franke (A5): Leveling the Lobbying Process: Effort Maximization in Asymmetric N-Person Contests, Kloster Bronnbach, Summerschool "Incentives and Behavioral Economies", 13.-21.08.2010, Bronnbach (außerdem gehalten: UECE Lisbon Meeting on Game Theory and Applications, 04.-06.11.2010, Lissabon).

J. Franke (A5): Conflict Networks, Research Workshop on Contests and Tournaments, Universität Magdeburg, 12.-13.11.2010.

R. Fried (C3): A Robust Test for a Difference in Location, International Conference on Robust Statistics ICORS, 28.06.-02.07.2010, Prag.

K. Friedrichs (B3): Auralization of auditory models, GfKL - CLADAG Conference 2010, 08.-10.09.2010, Florenz.

Y. Gu (A5): Gift Giving and Concern for Face, The 4th EBIM Doctoral Workshop on Economic Theory, Universität Bielefeld, 14.-15.12.2009.

Y. Gu (A5): Wage and Employment Effects of Workplace Representation: A 'Right to Co-Manage' Model, Universität zu Köln, 11.01.2010 (außerdem gehalten: Institute for Competition Economics (DICE), Heinrich-Heine-Universität Düsseldorf, 11.05.2010 und im Wirtschafts- und Sozialwissenschaftlichen Kolloquium an der TU Dortmund, 18.10.2010).

Y. Gu (A5): Imperfect Certification, Universität Wien, 09.11.2010.

Y. Gu (A5): Diskutant auf der Konferenz "Credit Rating Agencies and the Certification Process", Humboldt-Universität zu Berlin, 19.-20.11.2010.

M. Hallin (C1): Rank-based tests in α -stable families, International Conference on Robust Statistics, 28.06.-02.07.2010, Prag.

M. Hallin (C1): Multivariate quantiles: from L1 optimization to halfspace depth and local bilinear quantile regression, Statistics Seminar, University of Florida, 14.10.2010, Gainesville (außerdem gehalten: 2nd Princeton Day of Statistics, Princeton University, 22.10.2010 und im Statistics Seminar, University McGill, Montreal, 19.11.2010).

M. Hallin (C1): General dynamic factor models, Statistics Seminar, University of Texas at Dallas, 11.11.2010.

M. Hörmann (A4): Macroeconomic Effects of Quantitative Easing, Econometric Society World Congress (ESWC 2010), Shanghai, China, 17.-21.08.2010.

F. Jüssen (A4): The Life-Cycle and the Business-Cycle of Wage Risk: A Cross-Country Comparison, Econometric Society World Congress (ESWC 2010), Shanghai, 17.-21.08.2010.

Ch. Kiss (C2): Optimal designs for clinical trials with active control, mODa 9, Bertinoro, 14.-18.06.2010.

W. Leininger (A5): Effort Maximization in Asymmetric N-Person Contests, International Conference on Game Theory: 60 years of Nash Equilibrium, 28.07.-04.08.2010, Sao Paulo.

W. Leininger (A5): The majority decides - really? Kolloquium am Otto-Suhr-Institut, FU Berlin, 06.06.2010.

W. Leininger (A5): Participation, Incentives and Efforts in Contest: A Maximization Perspective, Kolloquium am Max-Weber-Institut, Universität Heidelberg, 22.11.2010.

W. Leininger (A5): Teilnehmer an Podiumsdiskussion "Enhancing the Efficiency of European Research Funding in the Social Sciences", 5th Max Weber-Programme Academic Careers Observatory Conference, Europäisches Hochschulinstitut, 24.11.2010, Florenz.

W. Leininger (A5): Participation, Incentives and Efforts in Contests: A Maximization Perspective, Universität Saarbrücken, Kolloquium, 29.11.2010.

O. Morell (C3): On robust jump-preserving smoothing, Statistische Woche 2010, 14.-17.09.2010, Nürnberg.

A. Neuenkirch (C5): Deriving numerical methods for SDEs driven by fractional Brownian motion, Satellite Workshop, Semester on Stochastic Partial Differential Equations, Isaac Newton Institute for Mathematical Sciences, University of York, 31.05-04.06.2010.

A. Neuenkirch (C5): Deriving numerical methods for SDEs driven by fractional Brownian motion, 6th European Conference on Mathematics for Industry, Bergische Universität Wuppertal, 26.-30.07.2010.

A. Neuenkirch (C5): Deriving numerical methods for SDEs driven by fractional Brownian motion, Modern Stochastics: Theory and Applications II, Kiev National Taras Shevchenko University, 07.-11.09.2010.

M. Rieth (A4): Fiscal and Monetary Policy Interaction in Turkey: Evidence from an Estimated DSGE Model, 3rd RGS Doctoral Conference, Bochum, 11.-12.02.2010.

N. Rudak (B1): JOP: Joint Optimization Plot, European Network for Business and Industrial Statistics (ENBIS10), 12.-16.09.2010, Antwerpen.

A. Schabert (A4): "Optimal Central Bank Lending, CEPR/ESI 14th Annual Conference on "How has our View of Central Banking changed with the Recent Financial Crisis", Izmir, Türkei, 28.-29.10.2010 (außerdem gehalten: CER-ETH Research Seminar, Zürich, 25.10.2010, Joint Lunchtime Seminar, Europäische Zentralbank, Frankfurt, 11.08.2010 und Ausschuss für Makroökonomik des Vereins für Socialpolitik, Hamburg, 25.06.-26.06.2010).

A. Schabert (A4): Default Risk Premia on Government Bonds in a Quantitative Macroeconomic Model, Conference "New Challenges for Public Debt in Advanced Economics", Straßburg, 16.-17.09.2010 (außerdem gehalten: Econometric Society World Congress (ESWC 2010), Shanghai, 17.-21.08.2010).

A. Schabert (A4): Macroeconomic Effects of Unconventional Monetary Policy, Universität Amsterdam, 19.02.2010.

A. Schnurr (C5): The Symbol of an Ito Process and its Relations to Fine Properties, DynStoch-Workshop, 17.-19.06.2010, Angers.

A. Schnurr (C5): The Symbol of an Ito Process and its Relations to Fine Properties, Universität Siegen, 16.07.2010.

A. Schnurr (C5): The Symbol of an Ito Process and its Relations to Fine Properties, Stochastic Processes and Their Applications, 06.-10.09.2010, Osaka.

O. Sh. Sharipov (C3): Central limit theorem for the sequences of $D[0;1]$ -valued weakly dependent random variables, Conference on Probability theory and mathematical statistics, 10.05.2010, Tashkent.

H. Trautmann (B4): Multiobjective Optimization and Process Control with Desirability Functions and Desirability Indices, Helmut-Schmidt-Universität der Bundeswehr, 01.12.2010, Hamburg.

M. van Kampen (A1): A nonparametric constancy test for copulas under mixing conditions, 20th Annual Meetings of the Midwest Econometrics Group, Washington University, 01.-02.10.2010, St. Louis.

M. Vetter (A1): Statistische Verfahren zur Analyse von hochfrequent beobachteten Semimartingalen, Universität Bayreuth, 27.07.2010.

M. Vetter (A1): Estimation of correlation for continuous semimartingales, Universität von Amsterdam, 24.08.2010 (außerdem gehalten: Universität Heidelberg, 07.12.2010).

M. Vetter (A1): Statistical methods for semimartingales observed at high frequency, Vortragsreihe, SFB 649 "Ökonomisches Risiko", Humboldt Universität Berlin, 07.-09.09.2010.

D. Vogel (C3): Elliptical graphical modelling, 10th International Conference on Robust Statistics (ICORS), 28.06.-02.07.2010, Prag.

S. Volgushev (C1): New estimators of the Pickands dependence function and a test for an extreme-value copula, 28th European Meeting of Statisticians 2010, Piräus, 20.08.2010.

S. Volgushev (C1): Some properties of Berans estimator for censored data, Statistikseminar der Universite Catolique de Louvain, 12.11.2010.

R. Walter (A1): Frailty in credit risk, Statistische Woche, 14.-17.09.2010, Nürnberg.

K. Webel (A1): Biased estimation of the memory parameter in the presence of intermittent chaos, Statistische Woche, 14.-17.09.2010, Nürnberg.

C. Weihs (B3, B4, C2): Classification in Particle Physics - A Case Study on the Use of Statistical Classification Methods in Particle Physics; 3. Deutsch-Japanisches Kolloquium, Karlsruhe, 20.07.2010.

C. Weihs (B3, B4, C2): Adaptive linear dimension reduction in a classification setting, GfKI-CLADAG Conference, 08.-10.09.2010, Florenz.

M. Wendler (C3): Bootstrap for U-Statistics of Dependent Data, Seminar of the Department of Statistics, Iowa State University, 18.10.2010, Ames (außerdem gehalten: Seminar of the Department of Statistics, University of Illinois, 28.10.2010, Urbana-Champaign).

D. Ziggel (A1) und D. Wied: Automatische Portfoliooptimierung durch Korrelationsanalyse verschiedener Anlageformen, Seminar bei der Vereinigung Technischer Analysten Deutschlands e.V., Börse Düsseldorf, 16.11.2010.

J. Woerner (C5): A unifying approach to fractional Lévy motions, Humboldt Universität Berlin, 02.06.2010.

J. Woerner (C5): Detecting and capturing correlation in financial data, House of Finance, Universität Frankfurt, 10.06.2010.

3) Poster

I. Agueusop, B. Bornkamp, K. Fokianos, R. Fried (C3) und K. Ickstadt: Outlier Detection in INGARCH Models, Valencia International Meeting on Bayesian Statistics, 03.–06.06.2010, Benidorm.

A. Schnurr (C5): Fine Properties of Processes Given as Solutions of Levy Driven SDEs, 6th International Conference on Lévy Processes: Theory and Applications, 26.07.-30.07.2010, Dresden.

Abschlussarbeiten

S. Abbas (B1, C1): Vergleich von robusten Regressionsschätzern für Zeitreihen mit diskretem Messniveau, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 05.08.2010.

I. Agueusop (C3): Bayes-Analyse zur Ausreißerkennung in INGARCH-Prozessen, Masterarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 10.09.2010.

C. Drinkuth (A1): Asymptotische Normalität eines verbesserten GMM-Schätzers in Modellen mit räumlich korrelierten Fehlern, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 28.09.2010.

A. El Kokhe (C2): Six Sigma – Prozessoptimierung mit Hilfe statistischer Methoden am Beispiel eines Schokoriegels, Masterarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 30.04.2010

P. Grafenschäfer (A1): Modellierung und Prognose von Ratings für forderungsbesicherte Wertpapiere, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 27.05.2010.

I. Hoffmann (C2): Quantilsschätzung zur Berechnung altersabhängiger Referenzlimits, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 13.02.2010.

H. Hristov (B4): Optimierung der Bewertung der Performance von Korrosionsschutzmaterialien für den Automobilbau mittels statistischer Methoden (am Beispiel von Korrosionsschutzprimern), Masterarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 05.05.2010.

K. Lang (C2): Vergleich von Clusterverfahren bei der Aufteilung von Tönen in drei Phasen, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 11.02.2010.

Ch. Lisakowski (C2): Auswirkung statistischer Methoden auf den Projekterfolg in Six Sigma, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 21.09.2010.

S. H. Meinke (C2): Over-/Undersampling für unbalancierte Klassifikationsprobleme im Zwei-Klassen-Fall, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 07.11.2010.

D. Otto (C3): Robuste nichtparametrische Glättung von Volatilitäten, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 03.09.2010.

M. Redecker (B3): Instrumentenklassifizierung durch Kombination von Audio-merkmalen, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 07.11.2010.

A. Skubala (A1): Strukturbrüche in Korrelationen der EURO STOXX 50 – Renditen, Bachelorarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 02.11.2010.

S. Stahlberg (A4): Asymptotische Verteilung von GMM-Schätzern in Modellen mit verschiedenen räumlichen Abhängigkeiten, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 27.10.2010.

V. Ueberfeldt (A1): Mittelfristige Prognose von Kreditausfällen - logistische Regression und Ereigniszeitanalyse im Vergleich, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 19.08.2010.

J. Upmann (C2): Anwendung und Eignung von Entscheidungsbaumalgorithmen im Rahmen der Zielkundenanalyse am Beispiel der RWE Vertrieb AG, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund 13.09.2010.

W. Xing (A1): Panelregression mit räumlich korrelierten Störgrößen, Diplomarbeit, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 18.11.2010.

Promotionen

C. Auer (B2): Iterative Identifikation von Lokations- und Dispersionsfaktoren bei nichtwiederholten Plänen.

T. Gerkmann (B3): Statistische Analyse cepstraler Koeffizienten und Anwendungen in der Sprachsignalverbesserung (Beurteilung: summa cum laude).

A. Khudnitskaya (A1): Improved credit scoring with multi-level statistical modelling.

Th. Kott (C5): Statistical Inference for Generalized Mean Reversion Processes.

I. Slavchev (A1): Bewertung multivariater Optionen mit Hilfe von Copulas.

D. Vogel (C3): Elliptical graphical modelling.

Sonstiges

Teilprojektleiter B. Franke (C5) hat zum Beginn des WS 2010/11 einen Ruf an die Université de Paris Ouest (Nanterre) erhalten und angenommen. Herzlichen Glückwunsch!

R. Fried (C3) organisiert und leitet den Kurs "Time Series Modelling and Computation" beim Workshop der ERCIM Working Group on Computing and Statistics, London, 10.-12.12.2010.

S. Kuhnt (B1) ist Herausgeberin eines Sonderhefts des AStA Advances in Statistical Analysis zu "Design and Analysis of Computer Experiments" (AStA 94/4) (zusammen mit David Steinberg, Tel Aviv University).

J. Kunert (B2, C2) organisiert die Sitzung "Crossover Designs" auf der International Conference of Design Experiments (ICODOE 2011), University of Memphis, 10.-13.05.2011.

A. Neuenkirch (C5) hat einen Ruf auf eine Juniorprofessur an die TU Kaiserslautern, Fakultät Mathematik, Lehrgebiet Computational Stochastics, erhalten und angenommen. Auch hier ganz herzlichen Glückwunsch.

J. Woerner (C5) organisiert und leitet die Arbeitsgruppe "Stochastische Prozesse - zwischen Physik und Finanzmathematik" (mit C. Kühn) auf der Sommerakademie La Villa der Studienstiftung des deutschen Volkes, 29.08.-11.09.2010, La Villa, Italien.

Gastwissenschaftler

J. Beran (Universität Konstanz): Vortrag "On bees, splines and fractional integration - an approach to modelling calcium imaging data", 23.11.2010.

S. Biedermann (University of Southampton): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 16.08.-03.09.2010.

R. Bhansali (Department of Mathematical Sciences, Xian Jiaotong-Liverpool University, China): Diskutant beim SFB-Symposium "High frequency data" und Arbeit mit K. Webel (A1) an dem gemeinsamen Projekt "Verhalten von Wavelet-Schätzern für Gedächtnisparameter bei Vorliegen von intermittierendem Chaos", 28.06.-02.07.2010.

U. Einmahl (Vrije Universiteit Brussel): Vortrag "Exponentielle Ungleichungen für empirische Prozesse", 19.11.2010.

S. Hörmann (Universite Libre de Bruxelles): Vortrag "Break detection in the covariance structure of multivariate time series models", 30.11.2010.

F. Neumann (Max-Planck-Institut für Informatik, Saarbrücken): Vortrag "Optimizing the Turbine Placement of Large Wind Farms", 25.10.2010.

E. Paparoditis (University of Cyprus, Nikosia): Vortrag "Bootstrap for time series - some recent results", 07.12.2010.

Ch. Rothe (Toulouse School of Economics): Zusammenarbeit mit D. Wied (A1) an dem gemeinsamen Projekt "Misspecification testing in a class of conditional distributional models", 09.-13.08.2010.

H. Saruwatari (Nara Institute of Science and Technology, Japan): Vortrag "Higher-Order Statistics Pursuit: Its Application to Blind Speech Extraction and Noise Reduction", 21.09.2010.

J. Segers (Université Catholique de Louvain): Vortrag "Nonparametric Bayesian inference on bivariate extremes", 16.11.2010.

D. E. Tyler (Rutgers University, New Jersey): Vortrag "Robust Methods for sparse multivariate data", 06.07.2010.

L. Wang (University of Manitoba, Winnipeg): mehrteiliges Seminar zum Thema "Second order least squares estimation", 12.-23.07.2010.

Y. Yu (University of California, Irving): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 23.-30.06.2010.

A. Zhigljavsky (Cardiff University): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 10.-12.10.2010.

Workshops, Tagungen

4. RGS Doctoral Conference in Economics, 21.02. – 23.02.2011, Technische Universität Dortmund.

Organisation für den SFB: W. Leininger.

<http://rgs-econ.org/>

Dependence in Probability and Statistics, 04.-08.04.2011, CIRM, Marseille-Luminy.

Organisation mit Hilfe des SFBs: H. Dehling.

http://www.cirm.univ-mrs.fr/Site_test/spip.php?rubrique2&EX=info_rencontre&annee=2011&id_renc=490&lang=fr

10. Workshop on Quality Improvement Methods, 03.-04.06.2011, Haus Villigst, Schwerte.

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

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/sfb823-workshops.html>

Die SFB-Akademie

Wegen der vielen positiven Rückmeldungen wurde das Seminar Stimm- und Sprechtraining von Dezember 2009 im August 2010 wiederholt. Dozent war wieder Reinhard Pedé (Nachrichtensprecher beim Deutschlandradio und einer der bekanntesten Sprechtrainer Deutschlands). Er hat Tipps und Tricks gelehrt, wie man bei Vorträgen und Vorlesungen verständlich und gleichzeitig stimmschonend spricht, wie sich ein trockener Mund oder Verhaspeln verhindern lassen und wie man ganz allgemein fesselnd vorträgt. Das Seminar war wieder ein großer Erfolg.

Im November 2010 wurde erstmals auch ein Seminar auf Englisch angeboten, Scientific Presentation. Dozent war Dr. John Kluempers von der Agentur textATRIUM (Promotion in Linguistik an der University of California in Los Angeles (UCLA), Radiojournalist für die Deutsche Welle, langjährige Lehrerfahrung in englischer und deutscher Sprache). Auch dieses Seminar war ein Erfolg. Ich möchte

deshalb alle SFB-Nachwuchsforscher noch einmal herzlich einladen, bei den Seminaren der SFB-Akademie mitzumachen und auch selbst Vorträge oder Kurse anzubieten. In einer zwanglosen Atmosphäre wollen wir fachübergreifend Ideen, Konzepte, Kompetenzen und Wissen austauschen und ein Netzwerk aufbauen. Je mehr Jungwissenschaftler sich aktiv einbringen, desto effizienter wird dieses Ziel erreicht. Es kann nie schaden, den Gegenstand seiner Forschung SFB-Kollegen aus anderen Projekten auf einer elementaren Ebene näher zu bringen, sei es in unseren Themenzirkeln oder in einer eigenen Vortragsreihe oder einem kleinen Einführungskurs! Die SFB-Akademie ist eure Plattform für all dies.

Aeneas Rooch, Leiter der SFB-Akademie



Diskussionspapiere

- 49/10 M. Kirchner und M. Rieth (A4): Sovereign risk and macroeconomic fluctuations in an emerging market economy.
- 48/10 H. Dette (A1) und K. Sen: Goodness-of-fit tests in long-range dependent processes under fixed alternatives.
- 47/10 A. Schnurr und J. H. C. Woerner (beide C5): Well-balanced Lévy driven Ornstein-Uhlenbeck processes.
- 46/10 K. Bissantz, N. Bissantz (C4) und D. Ziggel: Diversification effects between stock indices.
- 45/10 H. Dette, M. Marchlewski (beide C1) und J. Wagener: Testing for a constant coefficient of variation in nonparametric regression.
- 44/10 W. Krämer (A1): The cult of statistical significance.
- 43/10 H. Dehling und R. Fried (beide C3): Asymptotic distribution of two-sample empirical U-quantiles with applications to robust tests for structural change.
- 42/10 P. Behl, H. Dette (C1), M. Frondel und H. Tauchmann (beide A3): Choice is suffering: A focused information criterion for model selection.
- 41/10 T. Holland-Letz, H. Dette (C2) und D. Renard: Efficient algorithms for calculating optimal designs in pharmacokinetics and dose finding studies.
- 40/10 H. Dette (C2), B. Bornkamp und F. Bretz: On the efficiency of adaptive designs.
- 39/10 M. Wendler (C3): *U*-quantile processes and generalized linear statistics of dependent data.
- 38/10 M. Jovanovic (A1): Stock market confidence and copula-based Markov models.
- 37/10 B. Franke (C5) und Th. Kott (C3): Parameter estimation for the drift of a time-inhomogeneous jump diffusion process.
- 36/10 M. van Kampen und D. Wied (beide A1): A nonparametric constancy test for copulas under mixing conditions.
- 35/10 S. Biedermann, N. Bissantz (C4), H. Dette (C2) und E. Jones: Optimal designs for indirect regression.
- 34/10 M. Arnold (A1), N. Bissantz (C4), D. Wied (A1) und D. Ziggel: A new online-test for changes in correlations between assets.
- 33/10 M. Frondel (A3): Substitution elasticities: A theoretical and empirical comparison.
- 32/10 H. Dette, Ph. Preuß und M. Vetter (alle A1): A measure of stationarity in locally stationary processes with applications to testing.

- 31/10 H. Dette (C2) und V. B. Melas: A note on the de la Garza phenomenon for locally optimal designs.
- 30/10 M. Vetter (A1): Estimation of correlation for continuous semimartingales.
- 29/10 M. Frondel (A3), N. Ritter und C. Vance: Heterogeneity in the rebound: A quantile-regression approach.
- 28/10 N: Milke (C4): TRUEE – unfolding software.
- 27/10 F. Juessen, L. Linnemann und A. Schabert (alle A4): Understanding default risk premia on public debt.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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

