

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

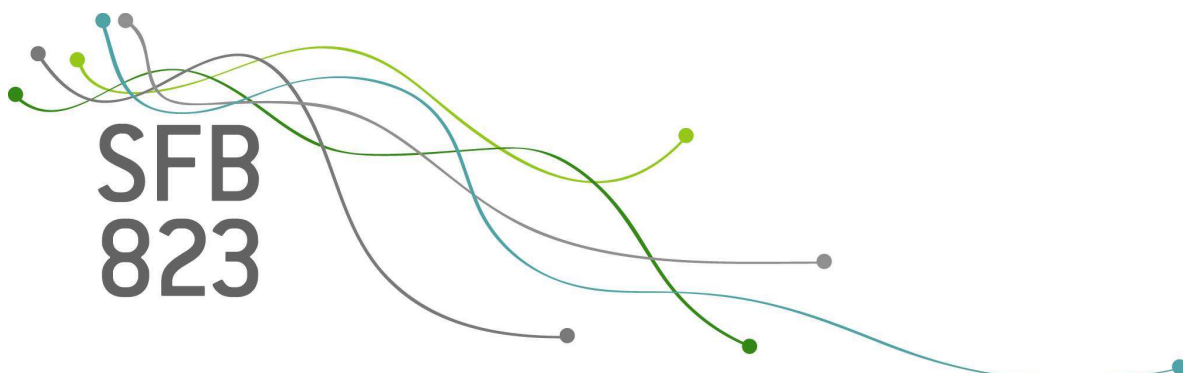
Ausgabe 7

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



Liebe Mitglieder, Freunde und Förderer des SFBs 823,

auch diese mittlerweile siebte Ausgabe unseres Infobriefs legt deutliches Zeugnis ab von der Vitalität und Produktivität unseres Verbundes. Ich habe mal nachgezählt: 60 publizierte oder zur Publikation angenommene wissenschaftliche Fachaufsätze seit Infobrief Nr. 6, das kann sich mehr als sehen lassen. Deswegen bin ich guten Mutes, dass wir die DFG-Gutachtergruppe bei der kommenden Begehung am 27. und 28. Februar überzeugen können, dieses Projekt auch in Zukunft zu fördern. Ich jedenfalls würde mich sehr freuen, Ihnen auch in den nächsten vier Jahren an dieser Stelle regelmäßig berichten zu dürfen, wie wir die Forschungsfront bei der statistischen Modellierung dynamischer Datensätze in Wirtschaft und Technik weiter vorangetrieben haben. An dieser Stelle begrüße ich auch ganz herzlich all diejenigen Kolleginnen und Kollegen, die für die beantragte zweite Förderphase als Projektleiterinnen oder -leiter neu hinzustoßen wollen. Mögen sie mit der gleichen Begeisterung zu Werke gehen, wie ich es bisher mit Freude bei den etablierten Projektleiterinnen und -leitern immer wieder feststellen durfte.

Mit zuversichtlichen Grüßen,

Ihr SFB-Sprecher

Walter Krämer

Rufe, Ehrungen und Preise

Betina Berghaus (A7(N)) wurde für ihre Masterarbeit mit dem Titel "Schätzen und Testen bei multivariaten Extremwertcopulas" mit dem Förderpreis des Vereins zur Förderung der Mathematik an der Ruhr-Universität Bochum ausgezeichnet.

Falko Jüßen (A4) hat von der Bergischen Universität Wuppertal einen Ruf auf eine W2-Professur für das Fach "Volkswirtschaft, insbesondere Internationale Wirtschaft und Regionalökonomik" erhalten.

Tobias Kley (C1) hat für sein Poster *Quantile-based Spectral Analysis* bei dem Workshop Financial Time Series Analysis: High-dimensionality, Non-stationarity and the Financial Crisis in Singapur vom 01.-22.06.2012 den Best Poster Award erhalten.

Wolfgang Leininger (A5) ist vom Senat der DFG zum Mitglied des Senatsausschusses für die Sonderforschungsbereiche und als wissenschaftliches Mitglied des Bewilligungsausschusses für die Sonderforschungsbereiche berufen worden.

Andreas Schabert (A4) hat von der Universität zu Köln einen Ruf auf eine W3-Professur für das Fach "Volkswirtschaftslehre, insbesondere Makroökonomik" erhalten.

Herzlichen Glückwunsch an alle Geehrten!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

M. Arnold und D. Wied (beide A1): Improved GMM estimation of panel data models with spatially correlated error components, erscheint in: *Papers in Regional Science*.

D. Belomestny (A6) und J. Schoenmakers: Multilevel dual approach for pricing American type derivatives, erscheint in: *Finance and Stochastics*.

D. Belomestny und V. Panov (beide A6): Abelian theorems for stochastic volatility models with application to the estimation of jump activity of volatility, erscheint in: *Stochastic Processes and Their Applications*.

D. Belomestny (A6): Solving optimal stopping problems by empirical dual optimization, erscheint in: *Annals of Applied Probability*.

B. Born, F. Jüßen (A4) und G. Müller: Exchange Rate Regimes and Fiscal Multipliers, erscheint in: *Journal of Economic Dynamics and Control*.

H. Dette (C2) und W. G. Müller: Optimal designs for regression models with a constant coefficient of variation, erscheint in: *Journal of Statistical Theory and Practice, Special Issue on "Design of Experiments and Related Combinatorics" in memory of Professor Jagdish N. Srivastava*.

H. Dette (C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Optimal design for linear models with correlated observations, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Dette (C1), J. Wagener und S. Volgushev (A1): Nonparametric comparison of quantile curves: A stochastic process approach, erscheint in: *Journal of Nonparametric Statistics*.

M. Frondel, N. Ritter und Ch. M. Schmidt (alle A3): Measuring Long-term Energy Supply Risks: A G7 Ranking, erscheint in: *Energy Studies Review 19 (1)*.

M. Frondel, Ch. M. Schmidt und N. aus dem Moore (alle A3): Marktwirtschaftliche Energiewende: Ein Wettbewerbsrahmen für die Stromversorgung mit alternativen Technologien, erscheint in: *Zeitschrift für Energiewirtschaft 37 (1)*.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): Heterogeneity in the Effect of Home Energy Audits: Theory and Evidence, erscheint in: *Environmental and Resource Economics*.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): Re-Identifying the Rebound: What About Asymmetry?, erscheint in: *The Energy Journal*.

C. Kustos und C. H. Müller (beide B5*): Analysis of crack growth with robust, distribution-free estimators and tests for non-stationary autoregressive processes, erscheint in: *Statistical Papers*.

P. Preuß (A1) und T. Hildebrandt (A1, C1): Comparing spectral densities of stationary time series with unequal sample sizes, erscheint in: *Statistics & Probability Letters*.

P. Preuß (A1), M. Vetter (A1) und H. Dette (A1, C1): Testing semiparametric hypotheses in locally stationary processes, erscheint in: *Scandinavian Journal of Statistics*.

P. Preuß (A1), M. Vetter (A1) und H. Dette (A1, C1): A test for stationarity based on empirical processes, erscheint in: *Bernoulli*.

C. Rothe und D. Wied (A1): Misspecification testing in a class of conditional distributional models, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

O. Sh. Sharipov und M. Wendler (C3): Normal limits, nonnormal limits, and the bootstrap for quantiles of dependent data, erscheint in: *Statistics & Probability Letters*.

S. Volgushev und H. Dette (beide C1): Nonparametric quantile regression for twice censored data, erscheint in: *Bernoulli*.

S. Volgushev (C1), M. Birke, H. Dette (A1) und N. Neumeier: Significance testing in quantile regression, erscheint in: *Electronic Journal of Statistics*.

D. Wied (A1): CUSUM-type testing for changing parameters in a spatial autoregressive model of stock returns, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

D. Wied, M. Arnold (beide A1), N. Bissantz (C4) und D. Ziggel: Über die Anwendbarkeit eines neuen Fluktuationstests für Korrelationen auf Finanzzeitreihen, erscheint in: *ASTA Wirtschafts- und Sozialstatistisches Archiv*.

D. Wied (A1), D. Ziggel und T. Berens: On the application of new tests for structural change on global minimum-variance portfolios, erscheint in: *Statistical Papers - Special Issue: Structural Breaks*.

* Resultate aus Vorarbeiten zu dem neuen Teilprojekt B5

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

C. Bayer und F. Jüßen (A4): The Life-Cycle and the Business-Cycle of Wage Risk: A Cross-Country Comparison, *Economics Letters* 117 (3), 831-833 (2012).

C. Bayer und F. Jüßen (A4): On the Dynamics of Interstate Migration: Migration Costs and Self-Selection, *Review of Economic Dynamics* 15 (3), 377-401 (2012).

D. Belomestny und V. Krätschmer (beide A6): Central limit theorems for law-invariant coherent risk measures, *Journal of Applied Probability* 49 (1), 1-21 (2012).

B. Bischl (B3, C2), O. Mersmann, H. Trautmann (B4, C2) und C. Weihs (B3, B4, C2): Resampling Methods in Model Validation, *Evolutionary Computation Journal* 20 (2), 249-275 (2012).

A. Bücher (A1), H. Dette (A1, C1) und S. Volgushev (C1): A test for Archimedeanity in bivariate copula models, *Journal of Multivariate Analysis* 110, 121-132 (2012).

A. Bücher (A1) und M. Ruppert: Consistent testing for a constant copula under strong mixing based on the tapered block multiplier technique, *Journal of Multivariate Analysis* 116, 208-229 (2013).

- M. Bücker, M. van Kampen und W. Krämer (alle A1): Reject inference in consumer credit scoring with nonignorable missing data, *Journal of Banking and Finance* 37 (3), 1040-1045 (2013).
- H. Dehling (C3, C5), R. Fried, D. Vogel (beide C3), O. Sh. Sharipov und M. Wornowizki (C3): Estimation of the Variance of Partial Sums of Dependent Processes, *Statistics & Probability Letters* 83, 141-147 (2013).
- H. Dette (C1) und C. Heuchenne: Scale checks in censored regression, *Scandinavian Journal of Statistics* 39 (2), 323-339 (2012).
- H. Dette (A1, C1), M. Marchlewski (C1) und J. Wagener: Testing for a constant coefficient of variation in nonparametric regression, *Annals of the Institute of Statistical Mathematics* 64, 1045-1070 (2012).
- H. Dette (C2), A. Pepelyshev und W. K. Wong: Optimal designs for composed models in pharmacokinetic-pharmacodynamic experiments, *Journal of Pharmacokinetics and Pharmacodynamics* 39, 295-311 (2012).
- H. Dette (C2) und M. Trampisch: Optimal designs for quantile regression models, *Journal of the American Statistical Association* 107 (499), 1140-1151 (2012).
- K. Fokianos und R. Fried (C3): Interventions in log-linear Poisson Autoregression, *Statistical Modelling* 12, 299-322.
- K. Friedrichs (B3) und C. Weihs (B3, B4, C2): Auralization of Auditory Models, Classification and Data Mining, *Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization*, 225-232, (2013).
- M. Hübner, Ch. M. Schmidt (A3) und B. Weigert: Energiepolitik: Erfolgreiche Energiewende nur im europäischen Kontext, *Perspektiven der Wirtschaftspolitik* 13 (4), 286-307 (2012).
- B. Hussong, W. Tillmann, S. Kuhnt, N. Rudak und A. Rehage (alle B1): Vergleich unterschiedlicher Strategien zur Prozessmodellierung beim HVOF thermischen Spritzen, *Tagungsband zum 15. Werkstofftechnischen Kolloquium, Chemnitz*, 68-73 (2012).
- F. Jüßen und L. Linnemann (beide A4): Markups and Fiscal Transmission in a Panel of OECD countries, *Journal of Macroeconomics* 34 (3), 674-686 (2012).
- P. Koch, B. Bischl (B3, C2), O. Flasch, T. Bartz-Beielstein, C. Weihs (B3, B4, C2) und W. Konen: Tuning and evolution of support vector kernels, *Evolutionary Intelligence* 5 (3), 153-170, (2012).
- N. Milke, M. Doert (beide C4), S. Klepser, D. Mazin, V. Blobel und W. Rhode (C4): Solving inverse problems with the unfolding program TRUEE: Examples in astroparticle physics, *Nuclear Instruments and Methods in Physics Research Sec. A: Accelerators, Spectrometers, Detectors and Associated Equipment* 697 (1), 133-147 (2013).
- J. Schiffner (C2), B. Bischl (B3, C2) und C. Weihs (B3, B4, C2): Bias-variance analysis of local classification methods, *Challenges at the Interface of Data Analysis*,

Computer Science, and Optimization, *Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization*, 49-57 (2012).

G. Sebastiani, A. Wawrosch, V. Franzen, A. Brosius und A.E. Tekkaya (alle B2): Inkrementelle Blechumformung flexibel unterstützen, *wt-online* 10, 645-650 (2012). [http://www.werkstattstechnik.de/wt/article.php?data\[article_id\]=69662](http://www.werkstattstechnik.de/wt/article.php?data[article_id]=69662)

H. Tauchmann (A3): Partial Frontier Efficiency Analysis, *Stata Journal* 12 (3), 461-478 (2012).

W. Tillmann (B1, B4), D. Biermann (B4), C. Weihs (B3, B4, C2), M. Ferreira (B4), Ch. Rautert und N. Raabe (beide B4): EBSD – orientation Analysis of Monocrystalline Diamonds Used for Diamond Metal Composites – Influence of Sample Preparation, *Materialwissenschaften und Werkstofftechnik* 43 (10), 832-838 (2012).

W. Tillmann, B. Hussong, S. Kuhnt, A. Rehage und N. Rudak (alle B1): Einführung eines Tageseffekt-Schätzers zur Verbesserung der Vorhersage von Partikeleigenschaften in einem HVOF-Spritzstrahl, *Thermal Spray Bulletin* 5 (2), 132-139 (2012).

W. Tillmann, B. Hussong, T. Priggemeier, S. Kuhnt, N. Rudak und H. Weinert (alle B1): Influence of Parameter Variations on WC-Co Splat Formation in an HVOF Process Using a New Beam-Shutter Device, *Journal of Thermal Spray Technology*, 2013, DOI: 10.1007/s11666-012-9881-8.

C. Vance (A3) und M. Peistrup: She's Got a Ticket to Ride: Gender and Public Transit Passes, *Transportation* 39 (6), 1105-1119 (2012).

C. Vance und N. Ritter (beide A3): The Phantom Menace of Omitted Variables: A Comment, *Conflict Management and Peace Science* 29, 233-238 (2012).

M. Vetter (A1) und H. Dette (A1, C1): Model checks for the volatility under microstructure noise, *Bernoulli* 18, 1421-1447 (2012).

J. Wagener und H. Dette (C1): Bridge estimators and the adaptive Lasso under heteroscedasticity, *Mathematical Methods of Statistics* 21 (2), 109-126 (2012).

J. Wagener, S. Volgushev (C1) und H. Dette (C1): The quantile process under random censoring, *Mathematical Methods of Statistics* 21 (2), 127-141 (2012).

C. Weihs (B3, B4, C2), K. Friedrichs (B3) und B. Bischl (B3, C2): Statistics for Hearing Aids: Auralization, *Data Analysis Methods and its Applications*, 183-196 (2012).

C. Weihs (B3, B4, C2), O. Mersmann, B. Bischl (B3, C2) et al.: A Case Study on the Use of Statistical Classification Methods in Particle Physics, Challenges at the Interface of Data Analysis, Computer Science, and Optimization, *Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization*, 69-77 (2012).

D. Wied, M. Arnold (beide A1), N. Bissantz (C4) und D. Ziggel: A new fluctuation test for constant variances with applications to finance, *Metrika* 75 (8), 1111-1127 (2012).

D. Wied (A1) und P. Galeano: Monitoring correlation change in a sequence of random variables, *Journal of Statistical Planning and Inference* 143 (1), 186-196 (2013).

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

R. Fried (C3), N. Raabe (B4) und A. M. Thieler (C3): On the Robust Analysis of Periodic Nonstationary Time Series, in: A. Colubi, K. Fokianos, E.J. Kontoghiorghes, G. González-Rodríguez (Hrsg.): Proceedings of the COMPSTAT 2012, Limassol, Zypern, 27.-31.08.2012, 245-257 (2012).

N. Raabe (B4), A. M. Thieler (C3), C. Weihs (B3, B4, C2), R. Fried (C3), C. Rautert und D. Biermann (beide B4): Modeling Material Heterogeneity by Gaussian Random Fields for the Simulation of Inhomogeneous Mineral Subsoil Machining, in: P. Dini und P. Lorenz (Hrsg.): SIMUL 2012: The 4th International Conference on Advances in System Simulation, Lissabon, Portugal, 18.-23.11.2012, 97-102 (2012).

W. Tillmann, B. Hussong, T. Priggemeier, S. Kuhnt, N. Rudak und H. Weinert (alle B1): Influence of Parameter Variations on WC-Co Splat Formation in an HVOF Process Using a New Beam Cutter Device, Conference Proceedings der ITSC 2012, Hrsg. ASM International, Ohio, USA, 12-21.

3) Populärwissenschaftliche Texte

M. Frondel (A3): Der Rebound-Effekt von Energieeffizienz-Verbesserungen, *Energiewirtschaftliche Tagesfragen* 62 (8), 12-17 (2012).

M. Frondel, Ch. M. Schmidt und N. aus dem Moore (A3): Die Energiewende und der Strompreis: Von Gewinnern und Verlierern, *ifo Schnelldienst* 65 (17), 3-8 (2012).

W. Krämer (A1): Der falsche Charme der Charts, *Frankfurter Allgemeine Zeitung*, Serie "Denkfehler, die uns Geld kosten", Nr. 22, 14.07.2012.

4) Radiobeiträge

Teilprojekt A3: "Energiewende: Was muss getan werden?", WDR 5 Morgenecho, Sendung vom 22.01.2013, 06:05 bis 08:55 Uhr.

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

H. Dehling (C3, C5): Nonparametric Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, Asymptotic methods in Stochastic - Conference in Honor of Professor Miklos Csörgö's 80th Birthday, Carleton University, Ottawa, Kanada, 04.07.2012.

H. Dehling (C3, C5): Dependent Processes in Probability Theory, Statistics and Analysis, Jahrestagung der Deutschen Mathematiker-Vereinigung, Saarbrücken, 17.-20.09.2012.

H. Dehling (C3, C5): Robust Change-Point Tests for Dependent Data, Tagung Recent Advances in Time Series (RATS 2012), Protaras, Zypern, 09.-12.06.2012.

W. Krämer (A1): Hysterie als Standortnachteil - Deutschland, eine Republik der Panikmacher?, Jahrestagung des Verbands Holzindustrie und Kunststoffverarbeitung Hessen-Thüringen e.V., Kleinheubach, 21.09.2012.

W. Krämer (A1): Vom Sinn und Unsinn im Umgang mit Risiken, Verbandstag des VdW Rheinland Westfalen e.V., Bonn, 25.09.2012.

R. Martin (B3): Audio Communication in Adverse Acoustic Environments - Challenges and Solutions, Keynote Talk at DASIP 2012, Karlsruhe, 25.10.2012.

R. Martin (B3): The Acoustic Signal Processing Challenge: Enabling Communication in Adverse Conditions, Keynote Talk at ClearLabs Workshop, Imperial College, London, Großbritannien, 30.10.2012.

Ch. M. Schmidt (A3): Herausforderungen der Energiewende aus Sicht der Energiepolitik, Nordrhein-Westfälische Akademie der Wissenschaften und Künste, Düsseldorf, 22.11.2012.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen

N. Bauer (C2): Tone onset detection using an auditory model, 36th Annual Conference of the German Classification Society on Data Analysis, Machine Learning and Knowledge Discovery (GfKI), Hildesheim, 01.-03.09.2012.

D. Belomestny (A6): On the complexity and the rates of convergence of simulation-based optimization algorithms for optimal stopping problems, Workshop on Computational Stochastics, Annweiler am Trifels, 25.-30.03.2012.

A. Bücher (A1): Sequential empirical copula processes under serial dependence, Jahrestagung der Deutschen Mathematiker-Vereinigung, Saarbrücken, 17.-20.09.2012.

H. Dehling (C3, C5): Integration of Mathematics into the Engineering Curriculum, Hochschulrektorenkonferenz Projekt Nexus: Concepts and Good Practice in Higher Education, Berlin, 29.10.2012.

R. Fried, T. Liboschik (beide C3) und K. Fokianos: On Outliers and Interventions in INGARCH Time Series, DAGSTAT 2013, Freiburg, 18.-23.03.2013.

B. Funke (C5): Eigenschaften adaptiver Nadaraya-Watson Schätzer und deren Anwendung in nicht-parametrischen Regressionsmodellen, Stochastik Doktorandinnen- und Doktorandentreffen 2012, Freudenstadt, 01.-03.08.2012.

R. Gralla (A5): Higher wages, overstaffing or both? The employer's assessment of problems regarding wage costs and staff level in codetermined establishments, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Göttingen, 09.-12.09.2012.

S. Hermann (B5*): Bayesian nonparametric mixture models for inhomogeneous poisson processes with application to crack growth, Statistische Woche, Wien, Österreich, 18.-21.09.2012.

B. Hussong (B1): Influence of Parameter Variations on WC-Co Splat Formation in an HVOF Process Using a New Beam Cutter Device, International Thermal Spray Conference 2012, Houston, Texas, USA, 21.-24.05.2012.

- B. Hussong (B1): Vergleich unterschiedlicher Strategien zur Prozessmodellierung beim HVOF thermischen Spritzen, Werkstofftechnisches Kolloquium, Chemnitz, 20.-21.09.2012.
- F. Jüßen (A4): Fiscal Policy, Sovereign Default, and Bailouts, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik, Göttingen, 09.-12.09.2012.
- K. Kettelhake (C2): Dose-Finding Studies with an Active Control, Joint Statistical Meeting 2012, San Diego, Kalifornien, USA, 28.07.-02.08.2012.
- W. Krämer (A1): So lügt man mit Statistik, HJ-Staudinger-Symposium der Deutschen Vereinten Gesellschaft für Klinische Chemie und Laboratoriumsmedizin e.V., Kloster Banz, 24.06.2012.
- W. Krämer (A1): Opfer des eigenen Erfolgs? Ausgewählte Lebenslügen der deutschen Gesundheitspolitik, 1. Symposium der Reihe kardiologie@sendesaal: Neue antithrombotische Substanzen – geht die Ära von Marcumar und Aspirin zu Ende?, Bremen, 15.09.2012.
- W. Krämer (A1): Food scares, synthetic risk behaviour and other irrational behaviour towards risk, Procter & Gamble Symposium M@GIC - How to Spark the Big Ideas? 4th Modeling & Imaging Symposium, Schwalbach/Taunus, 30.10.2012.
- W. Krämer (A1): Unabhängige Politikberatung in Zeiten von Wirtschaftskrisen, BfR Stakeholderkonferenz, Berlin, 20.11.2012.
- J. Kunert (B2, C2): Optimal designs for the Michaelis Menten model with correlated observations, LinStat (International conference on trends and perspectives in linear statistical inference) Bedlewo, Polen, 16.-20.07.2012.
- C. Kustoscz (B5*): Distribution-free estimation of crack growth processes by data depth, Statistische Woche, Wien, Österreich, 18.-21.09.2012.
- C. H. Müller (B5*): Statistical analysis of damage evolution, 12th Workshop on Quality Improvement Methods, Dortmund, 31.05.-01.06.2012.
- C. H. Müller (B5*): Statistical analysis of damage evolution via images, 5th International Conference of the ERCIM Working Group on Computing & Statistics, Oviedo, Spanien, 01.-03.12.2012.
- A. Nagathil, R. Martin (beide B3): Towards Timbre-controlled Reconstruction of Music Signals in the CQT Domain, 12th Workshop on Quality Improvement Methods, Dortmund, 31.05.-01.06.2012.
- B. Niestroj (A4): Investors Valuation for Assets Liquidity and Safety and the Corporate-Treasury Yield Spread, GSEFM Summer Institute 2012, Eltville am Rhein, 01.09.2012.
- P. Preuß (A1): On discriminating between long range dependence and non stationarity, New Developments in Econometrics and Time Series, Rom, Italien, 10.-11.09.2012.
- K. Proksch (C4): Simultane Konfidenzbereiche in multivariaten inversen Regressionsmodellen, Doktorandentreffen Stochastik, Freudenstadt, 01.-03.08.2012.

K. Proksch (C4): Uniform confidence bands for multivariate inverse regression models, ICNAAM 2012, Kos, Griechenland, 19.-25.09.2012.

N. Ritter (A3): Beyond the average elasticity - applying quantile panel regression to household mobility data, European Association of Environmental and Resource Economists 2012 (EAERE 2012), Prag, Tschechien, 27.-30.06.2012.

N. Rudak (B1): Simultaneous optimization of multiple correlated responses, Statistische Woche, Wien, Österreich, 18.-21.09.2012.

C. Vance (A3): Future Pain at the Diesel Pump? Potential Effects of the European Commission's Energy Taxation Proposal European Association of Environmental and Resource Economists 2012 (EAERE 2012), Prag, Tschechien, 27.-30.06.2012.

C. Vance (A3): Re-Identifying the Rebound: What About Asymmetry, International Association of Energy Economists (IAEE 2012), Venedig, Italien, 09.-12.09.2012.

C. Vance (A3): Who Does the Shopping? - German Time-use Evidence, 1996-2009, Transportation Research Board (TRB 2013), Washington, D.C., USA, 13.-17.01.2013.

M. Wendler (C3): Robust change point detection under dependence, Symposium on Asymptotic Methods in Stochastics, Carleton University, Ottawa, Kanada, 03.-06.07.2012.

M. Wendler (C3): Bootstrap for U-quantiles and U-statistics of dependent data, Jahrestagung der Deutschen Mathematiker-Vereinigung, Saarbrücken, 17.-20.09.2012.

M. Wendler (C3): Robust change point detection under dependence, Conference on non-stationarity in statistics and risk management, Centre International de Rencontres Mathématiques, Marseille, Frankreich, 21.-25.01.2013.

D. Wied (A1): Misspecification testing in a class of conditional distributional models, 66th European Meeting of the Econometric Society (EEA-ESEM), Malaga, Spanien, 27.-31.08.2012.

D. Wied (A1): Testing and monitoring changes in correlation and variances using an extended functional delta method, Jahrestagung der Deutschen Mathematiker-Vereinigung, Saarbrücken, 17.-20.09.2012.

J.H.C. Woerner (C5): From time series to continuous-time processes: continuous-time moving average processes, Workshop Nichtparametrische und nicht-lineare Zeitreihenanalyse, Pfalzakademie Lambrecht, 09.-11.09.2012.

* Resultate aus Vorarbeiten zu dem neuen Teilprojekt B5

3) Vorträge in Fakultätsseminaren

Ch. Bredemeier (A4): Minimum wages and female labor supply in Germany, gemeinsames Seminar "Makroökonomik und Arbeitsmärkte" der Universität Erlangen-Nürnberg und des Instituts für Arbeitsmarkt- und Berufsforschung der Bundesanstalt für Arbeit, Nürnberg, 22.01.2012.

- A. Bücher (A1): Nonparametric Inference for Lévy measures and copulas, Université de Pau, Frankreich, 08.11.2012.
- A. Bücher (A1): Epi- and hypoconvergence of the empirical copula process, Colloquium on Mathematical Statistics and Stochastic Processes, Universität Hamburg, 22.01.2013.
- H. Dehling (C3, C5): Dependence in Probability, Statistics and Analysis, Mathematisches Kolloquium, Universität Bayreuth, 15.11.2012 (auch: Mathematisches Kolloquium, Universität Mainz, 22.11.2012).
- H. Dette (C2): Geometrische Methoden in der Optimalen Versuchsplanung, 32. Kolloquium, Fachbereich Mathematik, Arbeitsgruppe Stochastik, TU Darmstadt, 11.06.2012.
- H. Dette (A1, C1): Quantile based spectral analysis, Lehrstuhl für Energiehandel und Finanzdienstleistungen, Universität Duisburg-Essen, 18.07.2012.
- H. Dette (A1, C1): Of copulas, quantiles, ranks, and spectra: An L_1 -approach to spectral analysis, Statistics Seminar, Centre for Mathematical Sciences, Lund University, Schweden, 26.10.2012 (auch: Forschungsseminar Mathematische Statistik, Weierstrass Institute, Berlin, 31.10.2012).
- M. Frondel (A3): Identifying the Rebound in Fuel Efficiency Improvements. Evidence for German Households, Fakultätsseminar, Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Universität Kassel, 16.01.2013.
- F. Jüßen (A4): Fiscal Policy, Sovereign Default, and Bailouts, Institut für Weltwirtschaft, Kiel, 30.10.2012.
- W. Krämer (A1): Ausgewählte Lebenslügen und Trends aus der deutschen Gesundheitspolitik, Absolventenfeier des Instituts für Pharmazie an der FU Berlin, 06.07.2012.
- W. Krämer (A1): Fehlalarm – Was machen wir beim Umgang mit Risiko- und Umweltdaten falsch?, Kolloquium Toxikologie an der Charité, Berlin, 25.10.2012.
- W. Krämer (A1): Vom Sinn und Unsinn im Umgang mit Risiken, CAMW-Kolloquium, Universität Münster, 13.12.2012.
- R. Martin (B3): Kompakte Repräsentation der Zeit-Frequenzstruktur von Audiosignalen für die Audioklassifikation, Kolloquium der Technischen Fakultät, Christian-Albrechts-Universität Kiel, 09.07.2012.
- P. Preuß (A1): On discriminating between long range dependence and non stationarity, Stochastik Seminar, Ruprecht-Karls-Universität Heidelberg, 27.11.2012.
- A. Schnurr (C5): Verallgemeinerungen des Blumenthal-Gettoor-Index und ihre Anwendungen, Christian-Albrechts-Universität Kiel, 06.12.2012.
- A. Schnurr (C5): Kenngrößen stochastischer Prozesse und ihre Beziehung zu Feineigenschaften der Trajektorien, Philipps-Universität Marburg, 22.11.2012.
- A. Schnurr (C5): Quo vadis Symbol (et ubi venis)?, Universität Duisburg-Essen, 15.01.2013.

M. Vetter (A1): Nonparametrics for Levy measures and copulas, Statistisches Seminar, Humboldt-Universität zu Berlin, 10.07.2012.

M. Vetter (A1): Statistische Verfahren für Levy-Maße und -Copulas, Mathematisches Kolloquium, Johannes Gutenberg-Universität Mainz, 29.11.2012.

D. Vogel (C3): On robust Gaussian graphical modeling, Hausdorff Center for Mathematics, Universität Bonn, 12.11.2012.

C. Weihs (B3, B4, C2): Statistics for Music in Hearing Aids, Fachbereich Mathematik und Informatik, Philipps-Universität Marburg, 04.12.2012.

M. Wendler (C3): Generalized quantiles with application to change point detection under dependence, Seminar of the Institute of Mathematics, National University of Uzbekistan, Tashkent, 03.10.2012.

M. Wendler (C3): Bootstrap for U-statistics of dependent data, Seminar of the Faculty of Mathematics, National University of Uzbekistan, Tashkent, 09.10.2012.

J. H. C. Woerner (C5): Continuous-time moving average processes: theory and applications, Ruhr-Universität Bochum, 09.01.2013.

4) Poster

K. Friedrichs (B3): Auralization of Auditory Models for Music Signals, AUDIS Conference, Satellite Workshop to IWAENC 2012, Aachen, 07.09.2012.

M. Frondel (A3): Re-Identifying the rebound: What about asymmetry?, European Association of Environmental and Resource Economists 2012 (EAERE 2012), Prag, Tschechien, 27.-30.06.2012.

T. Kley (C1): Quantile-based Spectral Analysis, Workshop "Financial Time Series Analysis: High-dimensionality, Non-stationarity and the Financial Crisis", Singapur, 01.-22.06.2012.

T. Kley (C1): Quantile-based Spectral Analysis, NBER-NSF Time Series Conference, Texas A&M, College Station, 26.-27.10.2012.

Ch. Rautert (B4): Statistische Prozessmodellierung bei der Bearbeitung inhomogener mineralischer Untergründe, GrindTec Internationale Fachmesse für Schleiftechnik, Augsburg, 19.-22.03.2012.

Ch. Rautert (B4): Einzelkornbezogene Betrachtung des Spanvorganges bei der Bearbeitung mineralischer Untergründe, Hagener Symposium der Pulvermetallurgie, Hagen, 29.-30.11.2012.

A. Rehage (B1): Statistical modelling of a thermal spraying process with additive day-effects, ENBIS 2012, Ljubljana, Slowenien, 09.-13.09.2012.

A. Wilk (C2): Efficiencies of designs in the simple linear regression model with correlated errors, Design and Analysis of Experiments 2012, Athens, USA, 17.-20.10.2012.

Abschlussarbeiten

J. Bandener (B3): Vergleich von modulationsbasierten Merkmalen in der Audio-signalklassifikation, Diplomarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Elektrotechnik und Informationstechnik, 29.05.2012.

L. Brüder (B3): Music Classification Using Constant-Q Based Features, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Elektrotechnik und Informationstechnik, 20.12.2012.

C. Drinkuth (A1): Finite und asymptotische Eigenschaften von GMM-Schätzern in Modellen mit räumlich korrelierten Fehlern, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 04.09.2012.

A. Dürre (C3): Konsistenzaussagen zur Spatial-Sign-Kovarianzmatrix, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 06.12.2012.

M. Gronau (B1): Vorhersage von Schichteigenschaften beim thermischen Spritzen mit funktionalen linearen Modellen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 04.10.2012.

J. Haring (C2): Vergleich von ANOVA und T^2 -Test bei Rangordnungsprüfungen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 06.11.2012.

K. Kempkes (A6): Bewertung von Amerikanischen Optionen mit Parametrisierungsmethoden, Diplomarbeit, Universität Duisburg-Essen, Fakultät für Mathematik, 25.07.2012.

D. Kirchhoff (C2): Verwendung eines Ohrmodells zur Einsatzzeiterkennung, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 05.11.2012.

R. Löser (A1): Prognose von Spreads synthetischer Collateralized Debt Obligations, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 31.10.2012.

Ch. Neumann (B2): Analyse nicht wiederholter faktorieller Versuchspläne bei Vorliegen eines aktiven Effekts, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 02.11.2012.

K. Pape (A1): Anwendung eines räumlich autoregressiven Modells zur Erklärung von Aktienrenditen auf verschiedene europäische Länder, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 08.08.2012.

T. Patschkowski (A1): Nichtparametrische Schätzung von Abhängigkeitsmaßen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 08/2012.

Ph. Probst (C3): Phi-Divergenzmaße: Vergleich von Verteilungen aus symmetrischen Verteilungsfamilien und Anpassungstests, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 19.07.2012.

J. Rathjens (C3): Robuste Regressionsmethoden im Sinusmodell, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 02.08.2012.

D. Rodrigues Recchia (A1): A comparison of two methods in credit scoring with application on metro data, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 16.10.2012.

J.-W. Schlattmann (B3): Entwicklung und Analyse eines Maßes zur Beschreibung der Komplexität von Audiosignalen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Elektrotechnik und Informationstechnik, 22.11.2012.

K. Schorning (A1): Das de-la-Garza-Phänomen im nichtlinearen Regressionsmodell, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 08/2012.

B. Schreier (C3): Zeitliche Modellierung von Insektenvorkommen mit Generalisierten Linearen Modellen unter Berücksichtigung von Zero Inflation, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 09.10.2012.

Ch. Schulz (C3): Modellierung von Insektenvorkommen mit Generalisierten Linearen Modellen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 20.09.2012.

B. Sischka (C3): Phi-Divergenzmaße: Vergleich von Verteilungen aus asymmetrischen Verteilungsfamilien und Tests, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 21.09.2012.

J. Smigierski (A1): Überwachung der Korrelation von EURO STOXX 50-Renditen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 23.10.2012.

J. Vestweber (C5): Grenzwertsätze für Modelle basierend auf Poissonschen Zufallsmassen und eine Anwendung auf Finanzdaten, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 20.01.2013.

C. Wieczorek (B1): Einfluss von Spritzparametern auf die Schichteigenschaften von HVOF-gespritzten WC-FeCrAl Verschleißschutzschichten, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät für Maschinenbau, 25.09.2012.

J. Wiedom (C3): Zeitliche Modellierung von Krankheitsfällen mit generalisierten linearen Modellen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 08.01.2013.

D. Zasada (A1): Kreditausfallprognose mit wenig Daten, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 15.06.2012.

Promotionen

C. A. Bassi Mbobda (A1): CDS und Ausfallwahrscheinlichkeitskorrelationen in Krisenzeiten, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 17.01.2013.

C. Kiss (C2): Neue Ergebnisse zur optimalen Versuchsplanung in nichtlinearen Modellen, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.06.2012.

E. Lockow (A1): Kontrollkarten auf Basis archimedischer Copulas, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 23.01.2013.

N. Milke (C4): Unfolding of the atmospheric neutrino flux spectrum with the new program TRUEE and IceCube, Fakultät Physik, TU Dortmund, 17.08.2012.

O. Morell (C3): On nonparametric methods for robust jump-preserving smoothing and trend detection, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 25.09.2012.

P. Preuß (A1): Statistical inference for locally stationary long-memory processes, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 09.11.2012.

K. Proksch (C4): Gleichmäßige Konfidenzbereiche für multivariate inverse Regressionsmodelle mit Faltungsoperatoren, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 09.11.2012.

N. Ritter (A3): Mobility in Germany - Car Dependency, Safety, and Fuel Elasticities, Fakultät für Wirtschaftswissenschaft, Ruhr-Universität Bochum, 05.11.2012.

A. Rooch (C3): Change-Point Tests for Long-Range Dependent Data, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 23.11.2012.

S. Titoff (C2): Likelihood Quotiententests für Modellidentifikation, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.06.2012.

M. Trampisch (C2): *D*-optimal designs in location scale models, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.06.2012.

Sonstiges

M. Arnold (A1, A4) vertrat im Wintersemester 2012/13 die W3-Professur für Ökonometrie an der Christian-Albrechts-Universität Kiel.

H. Dehling (C3, C5) wurde für 2013 in das Kolleg "Lehre hoch n" für Studienreformprojekte aufgenommen. Dieses Kolleg ist u. a. eine Initiative des Stifterverbands für die deutsche Wissenschaft und befasst sich mit Verbesserungen der Mathematikausbildung für Physik- und Ingenieurstudenten.

<http://www.lehrehochn.de>

S. Kuhnt (B1) ist Vorsitzende des Programmkomitees der ENBIS 2013, Ankara, Türkei, 16.-18.09.2013.

A. Rooch (C3) hat am 14.01.2013 an einer Podiumsdiskussion zu "Mathematik – Besichtigung einer schwierigen Disziplin" im Literarischen Salon der Leibniz-Universität Hannover teilgenommen.

M. Vetter (A1) vertrat im Wintersemester 2012/13 die W2-Professur für Stochastik an der Johannes Gutenberg-Universität Mainz.

SFB-Mitglieder unterwegs

T. Kley (C1) hat als Stipendiat der Ruhr University Research School mit M. Hallin (C1) vom 01.10.-30.11.2012 an der Princeton University, über Copula-Spektren geforscht.

T. Liboschik (C3) hat vom 01.-14.10.2012 gemeinsam mit K. Fokianos an der University of Cyprus zu "Strukturbrucherkennung in Zeitreihen von Zählraten" geforscht.

M. Wendler (C3) hat vom 22.09.-15.10.2012 Olimjon Sh. Sharipov an der National University of Uzbekistan in Taschkent besucht, um dort an dem Projekt "Bootstrap for functional data under dependence" zu arbeiten. Außerdem hat er dort zwei wissenschaftliche Vorträge gehalten und eine Minivorlesung (dreimal 45 Minuten) für Studierende angeboten.

Gastwissenschaftler

P. Anders (The Kavli Institute for Astronomy and Astrophysics, Beijing University, China): Vortrag "Einfluss stochastischer Effekte auf Sternhaufen: Beobachtungen und Analysen", 08.08.2012.

S. Biedermann (University of Southampton, Großbritannien): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 30.07.-10.08.2012.

A. Biswas (Indian Statistical Institute, Kalkutta, Indien): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.08.-24.08.2012.

C. Czado (Lehrstuhl für Mathematische Statistik, TU München): Vortrag "The world of vines", 12.06.2012.

M. Deistler (Institut für Wirtschaftsmathematik, TU Wien, Österreich): Vortrag "Identifiability of regular and singular multivariate autoregressive models from mixed frequency data", 22.01.2013.

B. Franke (Département de Mathématiques, Université de Bretagne, Brest, Frankreich): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 03.07.-31.07.2012.

T. Gneiting (Institut für Angewandte Mathematik, Universität Heidelberg): Vortrag: "Assessing uncertainty in complex simulation models: Ensemble copula coupling and the future of weather forecasting", 23.10.2012.

H. Holzmann (Philipps-Universität Marburg): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 22.08.-23.08.2012.

M. Kohler (Fachbereich Mathematik, TU Darmstadt): Vortrag "Statistische Methoden bei der Bewertung der Betriebsfestigkeit verzweigter Blechstrukturen", 20.11.2012.

V. Konakov (Higher School of Economics, National Research University, Moskau, Russische Föderation): Vortrag "Local limit theorems for Markov chains weakly converging to diffusions", 11.12.2012.

E. Paparoditis (Department of Mathematics and Statistics, University of Cyprus): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 06.12.-07.12.2012.

J. Segers (Institut de statistique, biostatistique et sciences actuarielles, Université catholique de Louvain, Louvain-la-Neuve, Belgien): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 15.10.-19.10.2012.

O. Sh. Sharipov (Uzbek Academy of Sciences, Taschkent, Usbekistan): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 01.11.-24.12.2012.

K. Tierney (Software Development Group, IT University of Copenhagen, Dänemark): Vortrag "Features for Exploiting Black-Box Optimization Problem Structure", 21.02.2013.

M. Vogt (Faculty of Economics, University of Cambridge, Großbritannien): Vortrag "Nonparametric Regression for Locally Stationary Time Series", 13.11.2012.

Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

Joint Statistical Meetings 2012, 28.07.-02.08.2012,
Optimal Designs for Nonlinear Regression Models with Applications
San Diego Convention Center, California.
Organisation Topic-Contributed Papers Session: H. Dette (C2)
<http://www.amstat.org/meetings/jsm/2012/index.cfm>

New Developments in Econometrics and Time Series, 10.09.-11.09.2012, Einaudi
Institute for Economics and Finance (EIFE), Rome.
Organisation: H. Dette (A1, C1, C2), M. Hallin (C1), M. Lippi.
<http://www.statistik.tu-dortmund.de/1740.html>



Workshop "New Developments in Econometrics and Time Series"
in Rom, 10.09.-11.09.2012.

Frontiers in Quantile Regression, 25.11.-01.12.2012, Mathematisches
Forschungsinstitut Oberwolfach.
Organisation: V. Chernozhukov, H. Dette (A1, C1, C2), X. He, R. Koenker.
http://www.mfo.de/occasion/1248b/www_view

Kommt noch:

German-Polish Joint Conference on Probability Theory and Mathematical Statistics, 06.06.-09.06.2013, Faculty of Mathematics and Computer Science of the Nicolaus Copernicus University, Torun.

Organisation für den SFB 823: H. Dehling (C3, C5), Weitere Mitglieder des Organisationskomitees: Nicole Bäuerle (Karlsruhe), Adam Jakubowski (Torun), Achim Klenke (Mainz), Rafal Latala (Warszawa), Teresa Ledwina (Wroclaw), Wojciech Niemiro (Torun), Markus Reiß (Berlin) und Tomasz Rolski (Wroclaw).

<http://www.gpps.umk.pl/?q=node/6>

Diese Konferenz steht in der Tradition der Stochastiktage, die alle zwei Jahre von der Fachgruppe Stochastik der Deutschen Mathematiker-Vereinigung veranstaltet werden, sowie der Jahrestagungen der Wahrscheinlichkeitstheoretiker und der Statistiker in Polen, und bildet die gesamte Breite der aktuellen Forschung im Bereich der Wahrscheinlichkeitstheorie und der mathematischen Statistik mit ihren vielfältigen Anwendungen ab. Darüber hinaus hat sie aber noch das besondere Ziel, die wissenschaftliche Kooperation zwischen den Wahrscheinlichkeitstheoretikern und Statistikern in Deutschland und Polen zu fördern. Für dieses Jahr sind Plenarvorträge geplant u. a. von Sara van de Geer (Zürich), Rama Cont (Paris, London), Dominique Picard (Paris) und Gerard Kerkycharian (Paris). Mehrere Sektionen haben einen starken Bezug zu Forschungsthemen des SFBs 823, etwa *Mathematical Finance* (Leiter: Lukasz Stettner, Peter Imkeller), *Applied Mathematical Finance* (Jacek Jakubowski, Thorsten Schmidt), *Statistics of Financial Data* (Rafal Weron, Wolfgang Härdle), *Change-Point Tests* (Teresa Ledwina, Roland Fried), *Statistics and Econometrics* (Jan Mielniczuk, Wolfgang Schmid), *Signal Analysis* (Miroslaw Pawlak, Ulrich Stadtmüller), *Stochastic Analysis* (Leszek Slominski, Jeannette Woerner) und *Extremes and Heavy-Tailed Phenomena* (Adam Jakubowski, Claudia Klüppelberg). Die Tagung wird vom SFB 823 mit einem Kostenzuschuss unterstützt.

Diskussionspapiere

- 04/13 N. Rudak, S. Kuhnt (beide B1) und E. Riccomagno: Numerical algebraic fan of a design for statistical model building.
- 03/13 T. Liboschik (C3), P. Kerschke, K. Fokianos und R. Fried (C3): Modelling interventions in INGARCH processes.
- 02/13 M. Borowski, N. Rudak, B. Hussong (alle B1), D. Wied (A1), S. Kuhnt (B1) und W. Tillmann (B1, B4): On- and offline detection of structural breaks in thermal spraying processes.
- 01/13 M. Hallin (C1), M. J. Moreira und A. Onatski: Group invariance, likelihood ratio tests, and the incidental parameter problem in a high-dimensional linear model.
- 58/12 H. Dette (C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Design for regression models with correlated errors.

- 57/12 B. Franke und M. Wendler (C3): Stable limit theorem for U-statistic processes indexed by a random walk.
- 56/12 M. Hallin (C1), R. van den Akker und B. J. M. Werker: Rank-based tests of the cointegrating rank in semiparametric error correction models.
- 55/12 H. Dette und K. Schorning (beide C2): Complete classes of designs for nonlinear regression models and principal representations of moment spaces.
- 54/12 M. Arnold und L. Linnemann (beide A4): The aggregate Euler equation and transaction services of government bonds.
- 53/12 B. Niestroj (A4): Investors valuation for assets liquidity and safety and the corporate-treasury yield spread.
- 52/12 Ch. Bredemeier und F. Jüßen (beide A4): Minimum wages and female labor supply in Germany.
- 51/12 K. Friedrichs und C. Weihs (beide B3): Comparing timbre estimation using auditory models with and without hearing loss.
- 50/12 N. Bauer (C2), K. Friedrichs (B3), D. Kirchhoff, J. Schiffner (C2) und C. Weihs (B3, C2): Tone onset detection using an auditory model.
- 49/12 A. Onatski, M. J. Moreira und M. Hallin (C1): Signal detection in high dimension: The multispiked case.
- 48/12 S. Hörmann, L. Kidzinski und M. Hallin (C1): Dynamic functional principal components.
- 47/12 C. Weihs, N. Raabe, M. Ferreira und C. Rautert (alle B4): Statistical process modelling for machining of inhomogeneous mineral subsoil.
- 46/12 H. Dehling (C3), B. Franke, T. Kott und R. Kulperger: Change point testing for the drift parameters of a periodic mean reversion process.
- 45/12 R. Gralla, K. Kraft (beide A5) und S. Volgushev (C1): The effects of works councils on overtime hours - a censored quantile regression approach.
- 44/12 M. Arnold (A1, A4), N. Raabe (B4) und D. Wied (A1): Identifying different areas of inhomogeneous mineral subsoil: spatial fluctuation approaches.
- 43/12 S. Jäschke (A1): Estimation of risk measures in energy portfolios using modern copula techniques.
- 42/12 N. Bauer, J. Schiffner und C. Weihs (alle C2): Comparison of parameter optimization techniques for a music tone onset detection algorithm.
- 41/12 H. Schmitz und H. Tauchmann (A3): Factor substitution in hospitals: a DEA based approach.
- 40/12 A. Reichert und H. Tauchmann (A3): When outcome heterogenously matters for selection: A generalized selection correction estimator.
- 39/12 D. Belomestny und V. Panov (beide A6): Estimation of the activity of jumps for time-changed Levy processes.

- 38/12 P. Preuß (C1) und M. Vetter (A1): Discriminating between long-range dependence and non-stationarity.
- 37/12 M. Hallin (C1) und C. Ley: Skew-symmetric distributions and Fisher information - The double sin of the skew-normal.
- 36/12 R. Gralla, K. Kraft und J. Lang (alle A5): Let's call it a day - The effect of works councils on working hours constraints in German establishments.
- 35/12 H. Dette, S. Titoff, S. Volgushev (alle C1, C2) und F. Bretz: Model identification for dose response signal detection.
- 34/12 S. Volgushev, J. Wagener und H. Dette (alle C1): Censored quantile regression processes under dependence and penalization.
- 33/12 S. Reynard und A. Schabert (A4): Monetary policy, interest rates, and liquidity premia.
- 32/12 M. Hallin (C1), Z. Lu, D. Paindaveine und M. Siman: Local constant and local bilinear multiple-output quantile regression.
- 31/12 B. Berghaus, A. Bücher (A1) und H. Dette (A1, C1): Minimum distance estimation of Pickands dependence function for multivariate distributions.
- 30/12 H. Dette, A. Pepelyshev (beide C2) und A. Zhigljavsky: 'Nearly' universally optimal designs for models with correlated observations.
- 29/12 N. Rudak, S. Kuhnt, B. Hussong und W. Tillmann (alle B1): On different strategies for the prediction of coating properties in a HVOF process.
- 28/12 M. Frondel, N. Ritter und Ch. M. Schmidt (alle A3): Measuring long-term energy supply risks: A G7 ranking.
- 27/12 A. Bücher (A1): A note on nonparametric estimation of bivariate tail dependence.
- 26/12 R. Fried (C3), I. Agueusop, B. Bornkamp, K. Fokianos, J. Fruth und K. Ickstadt: Bayesian outlier detection in INGARCH time series.
- 25/12 H. Dette (C2), V. B. Melas und P. Shpilev: Robust T-optimal discriminating designs.
- 24/12 A. Schnurr (C5): An ordinal pattern approach to detect and to model leverage effects and dependence structures between financial time series.
- 23/12 K. Proksch, N. Bissantz (beide C4) und Holger Dette (A1): Confidence bands for multivariate and time dependent inverse regression models.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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

