

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

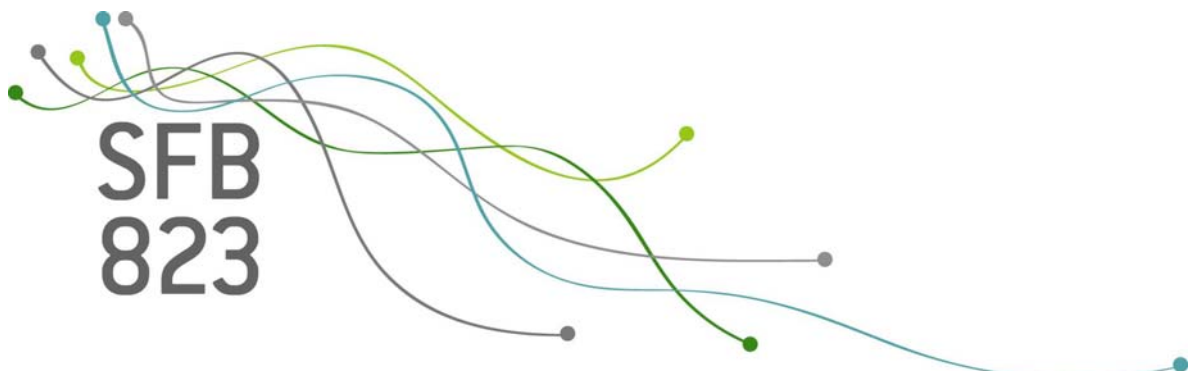
Ausgabe 8

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 des SFB 823,

das ist unser erster Infobrief in Förderphase zwei. Da haben wir eine Menge Vorschusslorbeeren abzuarbeiten, die von den Gutachtern so reichlich auf unseren Häuptern abgeladen worden sind, aber wenn ich mir weiter unten die beeindruckende Liste der seitdem entstandenen wissenschaftlichen Beiträge ansehe, wird mir da nicht bange. Ich bin stolz und froh, einem solchen Verbund als Sprecher vorstehen zu dürfen und freue mich schon sehr auf unsere nächste Klausurtagung in Villigst.

Zur Erinnerung: Anders als bisher wollen wir hier nicht projekt-, sondern themenweise vorgehen. Wie die einzelnen Themen sich präsentieren, ist den jeweiligen Koordinatoren überlassen, nur sollte jedes Projekt mindestens einmal mit einem Sprecher vertreten sein. Der übliche Appell "An die Arbeit!" ist wohl überflüssig, denn arbeiten tun wir alle schon ganz gut. In Villigst soll insbesondere die thematische Vernetzung innerhalb des SFBs hervorgehoben und diskutiert werden. Bis dahin wünsche ich allen noch einige schöne Herbsttage und einen guten Start ins Wintersemester.

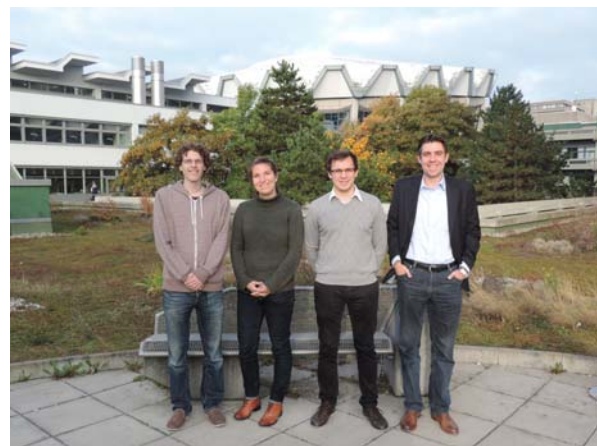
Ihr SFB-Sprecher Walter Krämer

Neu im SFB:

Teilprojekt A7 (Bücher / Weiß):

Statistische Modellierung von Abhängigkeiten in der Finanzökonomie mittels Copulas

Das Projekt untersucht neue Anwendungsgebiete und methodische Herausforderungen für mehr- und speziell hochdimensionale Copulamodelle zur Beschreibung räumlicher und zeitlicher Abhängigkeiten, mit Schwerpunkt sowohl auf angewandten Fragen der Finanzökonomie als auch auf theoretischen Problemen aus der mathematischen Statistik. Das Projekt liegt somit an der Schnittstelle zwischen mathematischer (Finanzmarkt-) Statistik und Finanzmarktökonomie. Es beschäftigt sich mit der Modellierung hochdimensionaler Kapitalmarktdatensätze unter Verwendung von Pair-Copula-Constructions, unter anderem unter nichtparametrischer Modellierung der bivariaten Bausteine dieser Abhängigkeitsmodelle.



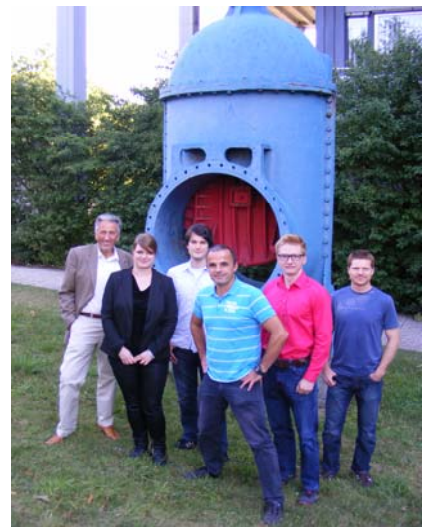
Teilprojekt B5 (Müller / Ickstadt / Maurer): Statistische Methoden für Schädigungsprozesse unter zyklischer Beanspruchung

Konventionelle Modelle etwa für Schadensentwicklungen in Autobahnbrücken können das Schädigungsverhalten nicht korrekt beschreiben. Vermutlich, weil Spannbeton bei niedrigen Belastungen nahe der Dauerfestigkeit nicht den angenommenen Gesetzmäßigkeiten genügt. Das Projekt schlägt hier realistischere Modelle vor. Da eine rein experimentelle Überprüfung der Schadensentwicklung bei niedrigen Belastungen aufgrund der langen Laufzeiten der Experimente nicht möglich ist, sollen Bayessche und ausreißerrobuste statistische Methoden dazu beitragen, die Rissentwicklung in Spannbeton auch bei niedrigen Belastungen adäquat zu beschreiben und Vorhersagen des Versagenszeitpunktes zu ermöglichen.



Teilprojekt B6 (Fried / Schumann): Robuste Analyse hydrologischer Zeitreihen mit Anwendungen für die hochwasserstatistische Regionalisierung

Das Projekt untersucht hydrologische Zeitreihen mit Blick auf die Extrema wichtiger Hochwasserkennwerte. Diese Daten werden als Grundlage für die Planung von Hochwasserschutzmaßnahmen und zur Bemessung langlebiger Bauwerke an Fließgewässern benötigt. Leider sind diese durch natürliche wasserbauliche Veränderungen, die Langzeitvariabilität der Messwerte und die oftmals nur geringe Länge der Beobachtungsreihe, welche nicht ausreichende Informationen für die Ränder der Verteilung liefert, mehr oder weniger gestört. Im Fokus liegt besonders die Schätzung von Werten mit sehr geringer Überschreitungswahrscheinlichkeit.



Rufe, Ehrungen und Preise

Walter Krämer (A1) ist erster Träger (mit Volker Mammitzsch und Nanny Wermuth) der DAGStat-Medaille für herausragende Verdienste um die Statistik in Deutschland.

Walter Krämer (A1) ist erster Träger des Preises "Lesbare Wissenschaft" der Stiftung Lesen.

Wolfgang Leininger (A5) ist für seine besonderen Verdienste in der Förderung der internationalen wissenschaftlichen Zusammenarbeit die Werner Heisenberg-Medaille verliehen worden.

Heike Trautmann (C2) hat einen Ruf auf die Professur "Wirtschaftsinformatik und Statistik" an der Westfälischen Wilhelms-Universität Münster angenommen.

Dominik Wied (A1) hat den diesjährigen Wolfgang-Wetzels-Preis von der Deutschen Statistischen Gesellschaft erhalten.

Herzlichen Glückwunsch an alle Geehrten!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

M. Andor (A3) und F. Hesse: The StoNED Age: A Departure Into a New Era of Efficiency Analysis? A Monte Carlo Comparison of StoNED and the "Oldies" (DEA and SFA), erscheint in: *Journal of Productivity Analysis*.

P. Behl (C1), G. Claeskens und H. Dette (A1, C1): Focused model selection in quantile, erscheint in: *Statistica Sinica*.

P. Behl (C1), H. Dette (A1, C1, C2), M. Frondel (A3) und H. Tauchmann: Energy Substitution: When Model Selection Depends on the Focus, erscheint in: *Energy Economics*.

M. Borowski (C1) und R. Fried (B6, C3): Robust Repeated Median Regression in Moving Windows with Data-Adaptive Width Selection, erscheint in: *Statistics and Computing*.

C. Bredemeier (A4): Imperfect Information and the Meltzer-Richard Hypothesis, erscheint in: *Public Choice*.

A. Bücher (A7): A note on nonparametric estimation of bivariate tail dependence, erscheint in: *Statistics & Risk Modeling*.

H. Dehling (C1, C3), O. Durieu und M. Tusche: Approximating Class Approach for Empirical Processes of Dependent Sequences Indexed by Functions, erscheint in: *Bernoulli*.

L. Denecke und Ch. H. Müller (beide B5): New robust tests for the parameters of the Weibull distribution for complete and censored data, erscheint in: *Metrika*.

H. Dette (C2), C. Kiss, N. Benda und F. Bretz: Optimal designs for dose finding studies with an active control, erscheint in: *Journal of the Royal Statistical Society, Ser. B*.

H. Dette und J. Kunert (beide C2): Optimal designs for the Michaelis Menten model with correlated observations, erscheint in: *Statistics*.

H. Dette (C2), V. B. Melas und P. Shpilev: Robust T-optimal discriminating designs, erscheint in: *Annals of Statistics*.

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*.

J. Draisma, S. Kuhnt (B1) und P. Zwiernik: Groups acting on Gaussian graphical models, erscheint in: *Annals of Statistics*.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): More Pain at the Diesel Pump? An Econometric Comparison of Diesel and Petrol Price Elasticities, erscheint in: *Journal of Transport Economics and Policy*.

P. Galeano und D. Wied (A1): Multiple break detection in the correlation structure of random variables, erscheint in: *Computational Statistics and Data Analysis*.

P. Grösche, C. M. Schmidt und C. Vance (beide A3): Identifying Free-Riding in Home-Renovation Programs Using Revealed Preference Data, erscheint in: *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik*.

S. Herrmann, H. Schwender, K. Ickstadt (B5) und P. Müller: A Bayesian changepoint analysis of ChIP-seq data of Lamin B, erscheint in: *BBA – Proteins and Proteomics*.

P. Messow und W. Krämer (A1): Spurious persistence in stochastic volatility, erscheint in: *Economics Letters*.

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

P. Preuß und M. Vetter (beide A1, C1): Discriminating between long-range dependence and non-stationarity, erscheint in: *Electronic Journal of Statistics*.

K. Proksch, N. Bissantz (beide C4) und H. Dette (A1): Confidence bands for multivariate and time dependent inverse regression models, erscheint in: *Bernoulli*.

A. Schnurr (C5): An Ordinal Pattern Approach to Detect and to Model Leverage Effects and Dependence Structures Between Financial Time Series, erscheint in: *Statistical Papers*.

A. Schnurr (C5): On Deterministic Markov Processes: Expandability and Related Topics, erscheint in: *Markov Processes and Related Fields*.

S. Sturtz und K. Ickstadt (B5): A comparison of Bayesian methods for flexible modelling of spatial risk surfaces in disease mapping, erscheint in: *Biometrical Journal*.

H. Tauchmann, S. Lenz, T. Requate und Ch. M. Schmidt (A3): Tobacco and Alcohol: Complements or Substitutes? A Structural Model Approach to Insufficient Price Variation in Individual-Level Data, erscheint in: *Empirical Economics*.

S. Volgushev (C1) und H. Dette (A1): Nonparametric quantile regression for twice censored data, erscheint in: *Bernoulli*.

D. Wied (A1), H. Dehling (C3), M. van Kampen (A1) und D. Vogel (C3): A fluctuation test for constant Spearman's rho with nuisance-free limit distribution, erscheint in: *Computational Statistics and Data Analysis*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

M. Arnold (A1), S. Stahlberg und D. Wied (A1): Modeling different kinds of spatial dependence in stock returns, *Empirical Economics* 44 (2), 761-774 (2013).

P. Behl (C1), H. Dette (A1, C1), M. Frondel (A3) und H. Tauchmann: Substitution between energy and other factors: When model selection depends on the focus, *Energy Economics* 39, 233-238 (2013).

B. Berghaus, A. Bücher (beide A7) und H. Dette (A1, C1): Minimum distance estimators of the Pickands dependence function and related tests of multivariate extreme-value dependence, *Journal de la Société Française de Statistique* 154, 116-137 (2013).

B. Bischl (C2), O. Mersmann, H. Trautmann und C. Weihs (beide C2): Resampling Methods for Meta-Model Validation with Recommendations for Evolutionary Computation, *Evolutionary Computation Journal* 20 (2), 249-275 (2012).

C. Bredemeier (A4) und F. Jüßen: Assortative Mating and Female Labor Supply, *Journal of Labor Economics* 31 (3), 603-631 (2013).

A. Bücher (A7) und M. Vetter (A1): Nonparametric inference on Lévy measures and copulas, *Annals of Statistics* 41, 1485-1515 (2013).

A. Bücher (A7) und S. Volgushev (A1, C1): Empirical and sequential empirical copula processes under serial dependence, *Journal of Multivariate Analysis* 119, 61-70 (2013).

K. Christensen, M. Podolskij und M. Vetter (A1, C1): On covariation estimation for multivariate continuous \hat{I} to semimartingales with noise in non-synchronous observation schemes, *Journal of Multivariate Analysis* 120, 59-84 (2013).

H. Dette (C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Optimal design for linear models with correlated observations, *Annals of Statistics* 41 (1), 143-176 (2013).

H. Dette und K. Schorning (beide C2): Complete classes of designs for nonlinear regression models and principal representations of moment spaces, *Annals of Statistics* 41 (3), 1260-1267 (2013).

H. Dette (A1), J. Wagener und S. Volgushev (C1): Nonparametric comparison of quantile curves: A stochastic process approach, *Journal of Nonparametric Statistics* 25 (1), 243-260 (2013).

H. Dehling (C1, C3), A. Roach (C3) und M. S. Taqqu: Nonparametric Change-Point Tests for Long-range Dependent Data, *Scandinavian Journal of Statistics* 40, 153-173 (2013).

S. Engelke und J.H.C. Woerner (C5): A unifying approach to fractional Lévy processes, *Stochastics and Dynamics* 13 (2), 1250017 (2013).

DOI: 10.1142/S0219493712500177

- S. Felder und H. Tauchmann (A3): Federal State Differentials in the Efficiency of Health Production: An Artifact of Spatial Dependence?, *European Journal of Health Economics* 14 (1), 21-39 (2013).
- M. Frondel, N. Ritter und Ch. M. Schmidt (alle A3): Measuring Long-term Energy Supply Risks: A G7 Ranking, *Energy Studies Review* 19 (1), 29-42 (2013).
- M. Frondel, Ch. M. Schmidt und N. aus dem Moore (alle A3): Marktwirtschaftliche Energiewende: Ein Wettbewerbsrahmen für die Stromversorgung mit alternativen Technologien, *Zeitschrift für Energiewirtschaft* 37 (1), 27-41 (2013).
- M. Frondel und C. Vance (beide A3): Correspondence: Don't Belittle the Rebound, *Nature* 494, 430 (2013).
- M. Frondel und C. Vance (beide A3): On Interaction Effects: The Case of Heckit and Two-part Models, *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik* 233 (1), 22-38 (2013).
- M. Frondel und C. Vance (beide A3): Heterogeneity in the Effect of Home Energy Audits: Theory and Evidence, *Environmental and Resource Economics*, 55 (3), 407-418 (2013).
- S. Kuhnt und N. Rudak (beide B1): Simultaneous optimization of multiple responses with the R Package JOP, *Journal of Statistical Software*, 54 (9), (2013).
- P. Preuß, M. Vetter und H. Dette (alle A1, C1): Testing semiparametric hypotheses in locally stationary processes, *Scandinavian Journal of Statistics* 40 (3), 417-437 (2013).
- N. Ritter und C. Vance (beide A3): Do Fewer People Mean Fewer Cars? – Population Decline and Car Ownership in Germany, *Transportation Research Part A: Policy and Practice* 50, 74-85 (2013).
- C. Rothe und D. Wied (A1): Misspecification testing in a class of conditional distributional models, *Journal of the American Statistical Association* 108 (501), 314-324 (2013).
- O. Sh. Sharipov und M. Wendler (C1, C3): Normal limits, nonnormal limits, and the bootstrap for quantiles of dependent data, *Statistics & Probability Letters* 83, 1028-1035 (2013).
- S. Volgushev (C1), M. Birke, H. Dette (A1) und N. Neumeyer: Significance testing in quantile regression, *Electronic Journal of Statistics* 7, 105-145 (2013).
- J. Wagener und H. Dette (A1, C1): The adaptive Lasso in high dimensional sparse heteroscedastic models, *Mathematical Methods of Statistics* 22 (2), 137-154 (2013).
- G. Weiß und H. Supper (beide A7): Forecasting liquidity-adjusted intraday Value-at-Risk with vine copulas, *Journal of Banking & Finance* 37, 3334-3350 (2013).
- R. Weißbach, W. Poniatowski und W. Krämer (A1): Nearest neighbor hazard estimation with left-truncated duration data, *AStA Advances in Statistical Analysis* 97 (1), 33-47 (2013).

D. Wied (A1): CUSUM-type testing for changing parameters in a spatial autoregressive model for stock returns, *Journal of Time Series Analysis* 34 (1), 221-229 (2013).

D. Wied (A1), M. Arnold (A1), N. Bissantz (C4) und D. Ziggel: Über die Anwendbarkeit eines neuen Fluktuationstests für Korrelationen auf Finanzzeitreihen, *AStA Wirtschafts- und Sozialstatistisches Archiv* 6 (3-4), 87-103 (2013).

T. Zhang, H.-C. Ho, M. Wendler (C1, C3) und W. B. Wu: Block Sampling under Strong Dependence, *Stochastic Processes and their Applications* 123, 2323-2339 (2013).

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

N. Bauer (C2), J. Schiffner und C. Weihs (C2): Comparison of parameter optimization techniques for a music tone onset detection algorithm, Proceedings of the 4th Meeting on Statistics and Data Mining (MSDM), Hammamet, 14.-15.03.2013, 28-34.

N. Bauer (C2), J. Schiffner und C. Weihs (C2): Comparison of Classical and Sequential Design of Experiments in Note Onset Detection, in: B. Lausen, D. Van den Poel und A. Ultsch (Hrsg.): Algorithms from and for Nature and Life. Classification and Data Analysis. Studies in Classification, Data Analysis, and Knowledge Organization, 501-509 (2013).

R. Fried, H. Elsaied, T. Liboschik (alle C3), K. Fokianos und S. Kitromilidou: On Outliers and Interventions in Count Time Series Following GLMs, in: S. Aivazian, P. Filzmoser und Y. Kharin (Hrsg.): Proceedings of Computer Data Analysis and Modeling, Belarusian State University, 10.-14.09.2013, 50-57 (2013).

S. Gergen, A. Nagathil und R. Martin (beide B3): Audio Signal Classification in Reverberant Environments Based on Fuzzy-Clustered Ad-hoc Microphone Arrays, International Conference on Acoustics, Speech, and Signal Processing (ICASSP) 2013, Vancouver, Canada, Mai 2013.

B. Hussong (B1), J. Pfeiffer, B. Lehmert, L. Wojarski und W. Tillmann (B1): Comparative Investigation of Standard WC-Co and a New WC-FeCrAl Feedstock Powder, Proceedings of the International Thermal Spray Conference, ASM International 2013, 8-15 (2013).

B. Hussong und W. Tillmann (beide B1): Auftragswirkungsgrad beim HVOF thermischen Spritzen von WC-Cermet-Pulver: Mikromechanische Vorgänge, Conference Proceedings zum 16. Werkstofftechnisches Kolloquium, Chemnitz, 05.-07.09.2013.

W. Krämer (A1): Kalte Enteignung - Wie die Euro-Rettung uns um Wohlstand und Renten bringt, Campus-Verlag, Frankfurt (2013).

S. Kuhnt und A. Rehage (beide B1): The concept of α -outliers in structured data situations, in Robustness and Complex Data Structures, Festschrift in Honor of Ursula Gather, eds. C. Becker, R. Fried und S. Kuhnt, Springer (2013).

Ch. H. Müller (B5): Upper and lower bounds for breakdown points, in: C. Becker, R. Fried und S. Kuhnt (Hrsg.): *Robustness and Complex Data Structures*. Festschrift in Honour of Ursula Gather, Springer, Berlin, Heidelberg, 67-84 (2013).

Ch. H. Müller (B5): D-optimal designs for lifetime experiments with exponential distribution and censoring, in: D. Ucinski, A. C. Atkinson und M. Patan (Hrsg.): *mODa 10 - Advances in Model-Oriented Design and Analysis*, Physica, Heidelberg, 179-186 (2013).

Ch. H. Müller und L. Denecke (beide B5): *Stochastik in den Ingenieurwissenschaften, Eine Einführung* mit R. Springer, Berlin, Heidelberg (2013).

I. Vatolkin, A. Nagathil (B3), W. Theimer und R. Martin (B3): Performance of Specific vs. Generic Feature Sets in Polyphonic Music Instrument Recognition, in *Proc. 7th International Conference on Evolutionary Multi-Criterion Optimization (EMO)*, Sheffield, Großbritannien, März 2013.

3) Populärwissenschaftliche Texte

N. aus dem Moore und Ch. M. Schmidt (A3): Die Energiewende finanzierbar gestalten: Konsistente Ziele formulieren, Entdeckungsprozesse ermöglichen, besonnene Umsetzung verfolgen, *Politische Bildung 2013 (2)*, 72-96 (2013).

4) Medienbeiträge

W. Krämer (A1): Irgendwann kommt in Europa der große Knall, Interview zur Euro-Krise in der *WirtschaftsWoche*, 20.06.2013.

<http://www.wiwo.de/politik/europa/walter-kraemer-irgendwann-kommt-in-europa-der-grosse-knall/8364538.html>

W. Krämer (A1): Der Ökonomen-Appell ist eine Aufforderung zum Rechtsbruch, Artikel zur Euro-Krise in der *WirtschaftsWoche*, 08.08.2013.

<http://www.wiwo.de/politik/europa/walter-kraemer-der-oekonomen-appell-ist-eine-aufforderung-zum-rechtsbruch/8580686.html>

W. Krämer (A1): Dem Durchschnitt auf den Fersen bleiben, Interview im Wirtschaftsmagazin *brand eins*, Ausgabe 10/2013.

W. Krämer (A1): Die wahre Eurokrise kommt erst noch, Gastkommentar in der *Fuldaer Zeitung*, 26.06.2013.

Ch. M. Schmidt (A3): Wir dürfen die Reformen nicht zurückdrehen, Interview zur Agenda für die nächste Bundesregierung mit *manager-magazin.de*, 23.05.2013.

<http://www.manager-magazin.de/politik/deutschland/a-899920.html>

Ch. M. Schmidt (A3): Steigende Energiekosten sind eine Gefahr, Interview in der *Frankfurter Allgemeinen Sonntagszeitung*, 02.06.2013.

Ch. M. Schmidt (A3): Muster ohne Wert?, Gastbeitrag zur Energiewende in der Rubrik 'Denkfabrik' der *WirtschaftsWoche*, 03.06.2013.

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

H. Dehling (C1, C3): Limit theorems for some robust change point tests in the presence of dependent data, 7th Aleksander Nagajew Lecture on Limit Theorems of Probability Theory, Nikolaus-Kopernikus-Universität, Torun, Polen, 9.06.2013.

W. Krämer (A1): Sackgassen der Exzellenz - Panik, Angst und Risiko, Kommunikationskongress, Berlin, 26.09.2013.

Ch. M. Schmidt (A3): Marktdesign Liberalisierung 2.0 - Ordnungspolitisches Gesamtkonzept für die Energiewende, 20. Vortrag im Rahmen der Handelsblatt Jahrestagung Energiewirtschaft 2013, Berlin, 24.01.2013.

Ch. M. Schmidt (A3): Klimawandel und alternde Gesellschaften: Eine selektive Übersicht, CLIMAGE Symposium, Universität Heidelberg, 13.06.2013.

A. Schumann (B6): Probabilities in Water Management – Applications of Statistical Tools, their Benefits and Limitations, 6th International Conference on Water Resources and Environment Research (ICWRER), Koblenz, 03.-07.06.2013.

A. Schumann (B6): Land unter? Hochwasserschutz zwischen Sicherheitsversprechen und Risikobewusstsein, Akademie der Wissenschaft und Künste NRW, Düsseldorf, 28.06.2013.

C. Weihs (B3, B4, C2): Statistical Simulation of a multi-phase tool machining a multi-phase workpiece, 3rd Bilateral German-Polish on Data Analysis and its Applications - GPSDAA 2013, Dresden, 25.-28.09.2013.

C. Weihs (B3, B4, C2): Simulation of Inhomogeneous Mineral Subsoil Machining using Delaunay Tessellations, 4th Meeting on Statistics and Data Mining, Hammamet, Tunesien, 14.-15.03.2013.

J. H. C. Woerner (C5): Inference for stochastic volatility models with jumps, Wissenschaftstag der Jahrestagung der DAV und DGVMF, Berlin, 26.04.2013.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen

M. Andor (A3): Quantities vs. Capacities: Minimizing the Social Cost of Renewable Energy Promotion, 8. Internationale Energiewirtschaftstagung, Wien, Österreich, 13.-15.02.2013.

M. Andor (A3): The StoNED Age: A Departure Into a New Era of Efficiency Analysis? A Monte Carlo Comparison of StoNED and the "Oldies" (DEA and SFA), Scottish Economic Society 2013, Perth, Australien, 08.-10.04.2013.

M. Andor (A3): EWEPA in Helsinki, SFA Pseudolikelihood - A new way to estimate Efficiency?, 13th European Workshop on Efficiency and Productivity Analysis, Helsinki, Finnland, 17.-20.06.2013.

M. Arnold (A1): Improved GMM estimation of random effects panel data models with spatially correlated error components, Statistische Woche 2013, Berlin, 18.09.2013.

- B. Bischl (C2) und M. Lang: Tutorial - Introduction to Parallel Programming and Batch Computing with R, DAGStat 2013, Freiburg, 18.-23.03.2013.
- C. Bredemeier (A4): Minimum Wages and Female Labor Supply in Germany, 62nd Annual Meeting of the French Economic Association (AFSE), Aix-en-Provence, Frankreich, 24.-26.06.2013.
- C. Bredemeier (A4): Inattentive Voters and Welfare-State Persistence, 12th Journées Louis-André Gérard-Varet Conference in Public Economics (LAGV), Aix-en-Provence, Frankreich, 26.-28.06.2013.
- A. Bücher (A7): When uniform convergence fails: Non-smooth empirical copula processes with applications to estimation and testing, Workshop on Model Selection, Nonparametrics and Dependence Modeling, Rennes, Frankreich, 08.-09.07.2013.
- A. Bücher (A7): Nonparametric Tests for Constancy of a Copula, Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series, Brussels (Belgien), 12.-13.09.2013.
- H. Dehling (C1, C3): Limit theorems for some robust change point tests in the presence of dependent data, International Workshop *Limit Theorems in Probability Theory and Asymptotic Statistics*, Uppsala, Schweden, 27.05.2013.
- H. Dehling (C1, C3): Mathematik in der Studieneingangsphase: Chancen und Herausforderungen, 4. VDI Qualitätsdialog Ingenieurausbildung, Hannover, 09.09.2013.
- H. Dette (A1, C1): Significance testing for quantile regression, Mathematisches Forschungsinstitut Oberwolfach, 21.-27.04.2013.
- H. Dette (A1, C1): Detection of structural breaks in multivariate time series, 1st Workshop on High-Dimensional Time Series in Macroeconomics and Finance, Wien, Österreich, 02.-04.05.2013.
- H. Dette (A1, C1): Significance testing for quantile regression, ENSAI, Rennes, Frankreich, 23.-26.05.2013.
- H. Dette (C2): Optimal designs, orthogonal polynomials and random matrices, International Linear Algebra Society 2013 Meeting, Providence, RI, USA, 03.-07.06.2013.
- H. Dette (C2): Design for linear models with correlated observations, 7th International Conference on Sensitivity Analysis of Model Output, Nice, Frankreich, 01.-04.07.2013.
- H. Dette (C2): Design for linear models with correlated observations, 7th International Conference on Sensitivity Analysis of Model Output, Nice, Frankreich, 01.-04.07.2013.
- H. Dette (A1, C1): Joint Statistical Meetings 2013, JASA Theory and Methods - Invited Paper Discussant, Montréal, Québec, Kanada, 03.-08.08.2013.
- S. Fremdt (A1, C1): Testing the equality of covariance operators in functional samples, S.Co. 2013, Mailand, Italien, 09.-11.09.2013.

S. Fremdt (A1, C1): Monitoring autoregressive moving average time series, Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series, Brüssel, Belgien, 12.-13.09.2013.

S. Fremdt (A1, C1): Functional change-point analysis with increasing number of projections, Statistische Woche, Berlin, 17.-20.09.2013.

R. Fried (B6, C3), Outliers and Robustness in INGARCH Models, ODAM 2013, Olomouc, Czech Republic, 12.-14.06.2013 (auch: CDAM 2013, Minsk, Belarus, 14.-19.09.2013).

R. Fried, H. Dehling und M. Wendler (alle C3), "Robust Shift Detection in Time Series", German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics, Torun, Poland, 06.-09.06.2013 (auch: European Meeting of Statisticians, Budapest, Hungary, 20.-26.07.2013).

K. Friedrichs (B3): Automatic Assessment of Hearing Aid Algorithms for Music Signals, DAGStat 2013, Freiburg, Germany, 18.-22.03.2013.

K. Friedrichs (B3): Feature Based Algorithm Selection for Tone Onset Detection, European Conference on Data Analysis (ECDA 2013), Luxemburg, 10.-12.07.2013.

B. Funke (C5): Adaptive Nadaraya-Watson like estimators for the estimation of the drift in a jump diffusion model, DYNSTOCH-Workshop, Kopenhagen, Dänemark, 17.-19.04.2013.

S. Hermann (B5): Bayesian Estimation in Stochastic Differential Equations Driven by a Nonhomogeneous Poisson Process with Application to Crack Growth, Statistische Woche, Berlin, 17.-20.09.2013.

B. Hussong (B1): Comparative Investigation of Standard WC-Co and a New WC-FeCrAl Feedstock Powder, International Thermal Spray Conference 2013, Busan, Republik Korea, 13.-15.06.2013.

B. Hussong (B1): Auftragswirkungsgrad beim HVOF thermischen Spritzen von WC-Cermet-Pulver: Mikromechanische Vorgänge, 16. Werkstofftechnisches Kolloquium, Chemnitz, 05.-07.09.2013.

M. van Kampen (A1): The nonparametric IV regression model with an Archimedian dependence structure, 28th European Economic Association meeting (EEA), Göteborg, Schweden, 26.-30.08.2013.

J. Kunert (C2): Blocking in Factorial Designs - Comments on a paper by Peter Goos, Invited discussion of "Design of Experiments" by Peter Goos at the Stu Hunter Research Conference, Heemskerk, Niederlande, 13.-15.03.2013.

J. Kunert (C2): Optimal designs in a model with interactions between products and units, Workshop MODA 10, Lagow Lubinski, Polen, 10.-14.06.2013.

C. Kustos (B5): Depth based estimators for explosive and non-linear auto-regression, Statistische Woche, Berlin, 17.-20.09.2013.

M. Lang und B. Bischl (C2): Automatic model selection and configuration for high dimensional survival analysis, Statistical Computing 2013, Schloss Reisingburg, Günzburg, Deutschland, 23.-26.06.2013.

- B. Niestroj (A4): The Effects of Quantitative Easing in an Estimated DSGE Model of the US Economy, 18th International Conference on Computing in Economics and Finance (CEF 2013), Vancouver, Kanada, 10.-12.07.2013.
- B. Niestroj (A4): Investors Valuation for Assets Liquidity and Safety and the Corporate-Treasury Yield Spread, 28th European Economic Association meeting (EEA), Göteborg, Schweden, 26.-30.08.2013 (auch: 18th Spring Meeting of Young Economists 2013 (SMYE), Aarhus, Dänemark, 30.05.-01.06.2013 und 10th Eurasia Business and Economics Society (EBES), Istanbul, Türkei, 23.-25.05.2013).
- H. Polattimur (A4): Housing, Collateral Constraints, and Fiscal Policy, 5th Doctoral Meeting of Montpellier, Montpellier, 13.-15.05.2013 (auch: 18th Spring Meeting of Young Economists 2013 (SMYE), Aarhus, Dänemark, 30.05.-01.06.2013 und 12th Journées Louis-André Gérard-Varet Conference in Public Economics (LAGV), Aix-en-Provence, Frankreich, 26.-28.06.2013).
- P. Preuss (C1): Detection of multiple structural breaks in multivariate time series, Joint Statistical Meetings 2013, Montréal, Québec, Kanada, 03.-08.08.2013.
- P. Preuss (C1): Discriminating between long-range dependence and non-stationarity, 18th European Young Statistician Meeting (EYSM), Osijek, Kroatien, 26.-30.08.2013.
- A. Rehage und S. Kuhnt (beide B1): The Benefit of Functional Data Analysis in a Thermal Spraying Process, DAGStat 2013, Freiburg, 18.-23.03.2013.
- A. Rehage und S. Kuhnt (beide B1): Strategies for Outlier Detection in Linear Regression with Functional Response, ENBIS-13, Ankara, Türkei, 15.-19.09.2013.
- N. Ritter (A3): How full is the tank? Insights on short-run fuel price reactions from German travel diary data, European Association of Environmental and Resource Economists, Toulouse, Frankreich, 26.-29.06.2013.
- N. Rudak und S. Kuhnt (beide B1): Multi-Objective Optimization based on Multivariate Mean-Covariance Models, ENBIS-13, Ankara, Türkei, 15.-19.09.2013.
- A. Schnurr (C5): An Ordinal Pattern Approach to Detect and to Model Leverage Effects and Dependence Structures Between Financial Time Series, DYNSTOCH-Workshop, University of Copenhagen, Dänemark, 17.-19.04.2013.
- A. Schnurr (C5): Path Properties of Stochastic Processes with Underlying Lévy Dynamics, German-Polish Stochastic Days, Torun, Polen, 06.-09.06.2013.
- A. Schnurr (C5): Path Properties of Lévy driven Processes, Stochastic Processes and Their Applications 2013, Boulder, CO, USA, 29.07.-02.08.2013.
- A. Schnurr (C5): Generalized Blumenthal-Gettoor Indices and Some Applications, Konferenz Building Bridges, TU Braunschweig, 13.-16.08.2013.
- A. Schnurr (C5): How to make generalized Lévy Processes Analytically Tractable, Workshop on Stochastic Processes, Universität Siegen, 22.-23.08.2013.
- M. Schulte und A. Schumann (beide B6): Systemic Flood Risk Assessments by Application of Multivariate Statistics, EWRA Porto 2013 – 8th International

Conference, Water Resources Management in an Interdisciplinary and Changing Context, Porto, Portugal, 26.-29.06.2013.

A. Schumann (B6): Flood Risks Mitigation by Reservoirs – Application of Multivariate Statistical Methods for Risk Assessments Downstream, Symposium "Considering Hydrological Change in Reservoir Planning and Management" IAHS/IAPSO/IASPEI Joint Assembly, Göteborg, Schweden, 22.-26.07.2013.

H. Supper (A7): Liquidity commonality and risk management, 6th Financial Risks International Forum, Paris, Frankreich, 25.-26.03.2013.

M. Vetter (A1, C1): Statistical Inference for Lévy measures and copulas, 29th European Meeting of Statisticians, Budapest, Ungarn, 20.-25.07.2013.

D. Vogel (C3): Change-point tests based on U-statistics and U-quantiles, German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics, Torun, Polen, 07.06.2013.

S. Volgushev (C1): Of quantiles, copulas, ranks and spectra: An L_1 approach to spectral analysis, 59th ISI World statistics congress, Hong Kong, 25.-30.08.2013.

S. Volgushev (C1): Empirical and Sequential Empirical Copula Processes under Serial Dependence and Weak Smoothness Conditions, Non-Gaussian Multivariate Statistical Models and their Applications Workshop, Banff international research station, Kanada, 20.-24.05.2013.

G. Weiß (A7): Why Do Some Insurers Become Systemically Relevant? The 40th Seminar of the European Group of Risk and Insurance Economists, Paris, Frankreich, 16.-18.09.2013 (auch: 20th Annual Meeting of the German Finance Association, Wuppertal, 27.-28.09.2013).

G. Weiß (A7): Why do U.S. banks contribute more to global systemic risk?, DFG-MPI International Conference on "The Structure of Banking Systems and Financial Stability", Bonn, 19.-20.09.2013 (auch: 20th Annual Meeting of the German Finance Association, Wuppertal, 27.-28.09.2013).

M. Wendler (C1, C3): Stable limit theorem for U-statistics processes indexed by a random walk; German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics, Torun, Polen, 06.06.2013 (auch: DMV-ÖMG-Kongress, Innsbruck, Österreich, 23.09.2013).

D. Wied (A1): Misspecification testing in a class of conditional distributional models, DAGStat 2013 Freiburg, 19.03.2013.

D. Wied (A1): An efficient and robust test for change-points in correlation, 28th European Economic Association meeting (EEA), Göteborg, Schweden, 26.-30.08.2013.

D. Wied (A1): Consistent testing for constant tail dependence with application in energy and financial markets, Minisymposium "Modeling multivariate risk", Statistische Woche 2013, Berlin, 18.09.2013.

J. H. C. Woerner (C5): Financial modelling with generalized moving average processes, DAGSTAT 2013, Freiburg, 18.-22.03.2013.

J. H. C. Woerner (C5): The Gumbel test for jumps in stochastic volatility models, German-Polish Stochastic Days, Torun, Polen, 06.-09.06.2013.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren

H. Dehling (C1, C3): Dependence in Probability, Statistics and Analysis, Probability Seminar, Nikolaus-Kopernikus-Universität, Torun, Polen, 08.03.2013.

H. Dehling (C1, C3): Empirical Process CLT for Markov Chains and Dynamical Systems, Statistics and Probability Seminar, Boston University, 21.03.2013.

H. Dette (A1, C1): Quantile Spectral Analysis, Research Seminar in Economics and Econometrics, Department of Economics, University of Geneva, 15.03.2013.

H. Dette (C2): Optimal designs, orthogonal polynomials and random matrices, Mathematics Colloquium, Département de Mathématique, Université Libre de Bruxelles, 01.03.2013.

M. Frondel (A3): Identifying the Rebound, Fakultät Wirtschaftswissenschaften, Universität Siegen 12.06.2013.

W. Krämer (A1): Irrationale Bewertung von Risiken, Frankfurt School of Management, 25.06.2013 (auch: Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Universität Linz, 18.04.2013).

P. Preuss (C1): Detection of multiple structural breaks in multivariate time series, London School of Economics, 22.03.2013.

A. Schnurr (C5): Blumenthal-Gettoor-Indices for Homogeneous Diffusions with Jumps, Seminar Finance and Insurance Math., Vilnius, Litauen, 13.03.2013.

A. Schnurr (C5): Symbole und Indizes stochastischer Prozesse und ihre Beziehung zu Pfadigenschaften, Fachbereich Mathematik, Universität Duisburg-Essen, 17.06.2013.

A. Schnurr (C5): Über die Analyse verallgemeinerter Lévy-Prozesse, Oberseminar "Stochastik", Mathematisches Institut, Universität zu Köln, 08.07.2013.

M. Schulte (B6): Einführungsvortrag zur Software "EXANTO", Seminar "Ermittlung von Hochwasserwahrscheinlichkeiten", Ruhr-Universität Bochum, 06.02.2013.

M. Vetter (A1): On discriminating between long-range dependence and non stationarity, Statistisches Seminar, Weierstraß-Institut Berlin, 16.01.13.

M. Vetter (A1): Statistical inference on Lévy measures and copulas, Statistisches Seminar, Louvain-la-Neuve, 03.05.13.

S. Volgushev (C1): Modellwahl für zensierte Quantilsregression, Kolloquium über Mathematische Statistik und Stochastik, Universität Hamburg, 11.06.2013.

C. Weihs (B3, B4, C2): Statistics for Music in Hearing Aids - Automatisierte Bewertung von Hörgerätealgorithmen mittels Klassifikations- und Regressionsmethoden, Kolloquium der Biometriebeauftragten des Senats der Bundesforschungsanstalten, Universität Braunschweig, 19.03.2013.

M. Wendler (C1, C3): Invariance principle for generalized quantiles under dependence, Colloquium on stochastic properties on dynamical systems and random walks, Université de Bretagne Occidentale, Brest, Frankreich, 23.05.2013.

4) Poster

M. Arnold (A1), N. Raabe (B4) und D. Wied (A1): Testing for structural changes at unknown positions with application to inhomogeneous mineral subsoil, DAGStat poster award, DAGStat 2013, Freiburg, 20.03.2013.

K. Ickstadt (B5): Nonparametric Bayesian models unmix cell populations with distinct protein-network topologies, 9th Conference on Bayesian Nonparametrics, Amsterdam, Niederlande, 10.-14.06.2013.

C. Rautert (B4): Statistische Prozessmodellierung bei der Bearbeitung inhomogener mineralischer Untergründe, Zerspanen im modernen Produktionsprozess, Fachgespräch zwischen Industrie und Hochschule, Dortmund, 10.-11.09.2013.

Abschlussarbeiten

S. Abbas (C3): Detektion von Nanoobjekten in Graustufenbildern und Bildsequenzen mittels robuster Zeitreihenmethoden zur Strukturbrucherkennung, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 15.07.2013.

A. Betken (C3): Strukturbruchtests mit Selbstnormierung, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 26.09.2013.

S. Broxtermann (C3): Strukturbruchtests auf Basis von Divergenzmaßen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 03.05.2013.

S. Fischer (B6): Generalisierte L-Statistiken und der Generalisierte Medianschätzer für unabhängige und stark mischende Zufallsvariablen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 02.07.2013.

S. Gebauer (C3): Robuste Tests auf Strukturbruch in der Varianz eines stationären Prozesses, Diplomarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 17.08.2013.

C. Gerstenberger (C3): Tests zur Unterscheidung zwischen Prozessen mit starkem Gedächtnis und Prozessen mit kurzem Gedächtnis mit Sprüngen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 25.09.2013.

F. Ideler (A1): Anwendungen von Quantilsregressionen auf einen Lohndatensatz aus dem current population survey in den USA, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 11.07.2013.

M. Jastrow (B4): Implementierung und Anwendung mehrdimensionaler Variogramme, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 20.08.2013.

P. Kinsvater (B6, C3): Test auf Strukturbruch in bedingten Quantilen für mischende Prozesse, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 13.06.2013.

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

J. Kohlenbach (B1): Ausreißerererkennung in funktionalen Daten am Beispiel eines thermischen Spritzprozesses, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 14.06.2013.

F. Knorre (A1): Verhalten eines Fluktuationstests auf konstante Korrelation unter zeitvariablen Varianzen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 16.05.2013.

H. Liang (A1): Abhängigkeitsstrukturen bei GARCH-Prozessen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 16.01.2013.

G. Muccioli (B1): Chain Graph Models: an Application to a Thermal Spraying Process, Masterarbeit, Università di Genova, Facoltà di Scienze Matematiche, Fisiche e Naturali, 15.02.2013.

K. F. Nolte (A1): Schrumpfschätzung varianzminimaler Portfoliogewichte – Simulationsstudie und empirische Anwendung, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 02.08.2013.

O. Özgen (A1): Simulation und Schätzung von Wurzel-Diffusionsprozessen, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 25.07.2013.

C. Pomwap Fiassap (A1): Verbesserte Korrelationsschätzung bei empirischer Nichtstationarität durch lokale Normalisierung, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 16.08.2013.

G. Popov (A1): Pitfalls in Modern Risk Management - Extreme Events and Their Dependencies, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Mathematik, 26.07.2013.

N. Reckmann (A1): Die Kleinstichproben-Eigenschaften von multivariaten Zusammenhangsmaßen, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 22.02.2013.

D. Schindler (B5): Vergleich multivariater Qualitätskontrollkarten, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 02.09.2012.

J. Tewes (C3): Tests auf Strukturbruch in der Verteilung abhängiger Daten, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, 19.09.2013.

R. Van Hecke (C1): Modellvalidierung in lokal stationären Zeitreihen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, April 2013.

M. Verkely (A1): Empirischer Vergleich verschiedener GARCH-Modelle zur Prognose des Value at Risk, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 03.07.2013.

A. Wollenberg (A1): Beurteilung und Vergleich ausgewählter Value at Risk Schätzverfahren anhand einer Simulationsstudie, Bachelorarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 09.07.2013.

Promotionen

B. Bischl (C2): Model and Algorithm Selection in Statistical Learning and Optimization, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 30.08.2013.

M. Guhlich (C1): Tests auf Modellannahme in der nichtparametrischen Quantilsregression, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 14.06.2013.

A. Ntiwa Foudjo (C3): Robust normality test and robust power transformation with application to state change detection in non normal processes, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 04.06.2013.

J. Vogt (A1): Reduced Form Credit Risk Models and the Second Dimension Risk Premium - Technical Foundations, Estimation and Applications, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 19.08.2013.

A. Wilk (C2): D-Effizienzen von Versuchsplänen im einfachen linearen Regressionsmodell bei korrelierten Fehlern, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 19.02.2013.

Sonstiges

H. Dette (C1) organisierte und leitete die Sektion "Frontiers in quantile regression" auf dem 59th ISI World Statistics Congress, Hong Kong, 25.-30.08.2013.

R. Fried (B6, C3) organisierte und leitete die Sektion "Change-point tests" bei der *German-Polish joint Conference on Probability Theory and Mathematical Statistics*, Torun, Polen, 06.-09.06.2013.

R. Fried (B6, C3) organisiert und leitet den Track "Time Series Modelling and Computation" beim Workshop der *ERCIM Working Group on Computing and Statistics*, London, 12.-14.12.2013.

C. Becker, R. Fried (B6, C3) und S. Kuhnt (B1) sind Herausgeber der im Springer-Verlag erschienenen Festschrift in Honor of Ursula Gather "Robustness and Complex Data Structures".

A. Schnurr (C5) organisierte gemeinsam mit A. Behme die Sektion "Lévy Driven Processes" bei der Konferenz *Stochastic Processes and Their Applications 2013*, Boulder, CO, USA, 29.07.-02.08.2013.

A. Schnurr (C5) hat im Sommersemester 2013 die W3-Professur Stochastik an der Universität Siegen vertreten.

A. Schumann (B6) ist Herausgeber des Red Books "Considering Hydrological Change in Reservoir Planning and Management", IAHS-publication 362.

SFB-Mitglieder unterwegs

A. Bücher (A7) hat vom 01.02. bis 30.09.2013 an der Université catholique de Louvain mit Johan Segers zu *empirischen Copula Prozessen* und mit Ingrid Van Keilegom und Anouar El Ghoush zu *Quantilsregression zensierter Daten* geforscht.

H. Dehling (C1, C3) hat vom 15. bis 28.03.2013 gemeinsam mit M. Taqqu an der Boston University zum Thema *Strukturbruch in LRD-Zeitreihen* geforscht.

D. Vogel (C3) hat vom 14. bis 25.04.2013 gemeinsam mit D. Tyler an der Rutgers University (New Jersey) über *robuste graphische Modelle* gearbeitet.

Gastwissenschaftler

J. Asscher (Department of Quality and Reliability Engineering, Kinneret Academic College on the Sea of Galilee, Israel): Vortrag "Design of Experiments (DOE) in Industry and Academic Research: Examining Differences, Misconceptions and Common Challenges", 16.07.2013.

A. Aue (Department of Statistics, University of California, Davis, USA): Vortrag "Predicting functional time series", 18.06.2013.

A. Baumgart (Wirtschaftsinformatik und Statistik, Westfälische Wilhelms-Universität Münster): Vortrag "Cluster Stability: Concepts and Determinants", 06.08.2013.

A. Biswas (Indian Statistical Institute, Kolkata, India): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 08.06.-09.06.2013.

S.-K. Chao (Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Humboldt-Universität zu Berlin), Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 04.08.-15.08.2013.

M. Eichler (Department of Quantitative Economics, Maastricht University, Niederlande): Vortrag "Fitting dynamic factor models to nonstationary time series", 09.07.2013.

K. Fokianos (Department of Mathematics and Statistics, University of Cyprus): Vortrag "Likelihood inference for INAR(p) models by saddlepoint approximation", 25.06.2013.

B. Franke (Département de Mathématiques, Université de Bretagne, Brest): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 12.08.-31.08.2013.

S. Fremdt (Fakultät Mathematik, Universität zu Köln): Vortrag "Asymptotic Methods in Change-Point Analysis", 14.05.2013.

M. Hallin (ECARES, Université Libre de Bruxelles, Belgien): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 09.07.-10.07.2013.

R. de Jong (Department of Economics, Ohio State University, USA): Vortrag "The Econometrics of the Hodrick-Prescott Filter", 02.07.2013.

M. Konstantinou (Research Group Statistics, University of Southampton, UK): Vortrag: "Optimal designs for survival data", 08.07.-09.07.2013.

J. Kukla (Fakultät für Mathematik, Ludwig-Maximilians-Universität München): Vortrag "Extremal Parameters of Galton-Watson Processes", 09.09.2013.

V. B. Melas (St. Petersburg State University, Russia): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 04.03.-29.03.2013.

A. Pepelyshev (Fachgruppe Mathematik, RWTH Aachen): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 18.03.-22.03.2013.

S. Savage (Department of Management Science and Engineering, Stanford University, California, USA): Vortrag: "Probability Management: Unambiguous Uncertainty", 10.09.2013.

M. Vogt (Faculty of Economics, University of Cambridge, Großbritannien): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 01.04.-05.04.2013.

A. Vosseler (Lehrstuhl für Statistik und Ökonometrie, Otto-Friedrich-Universität Bamberg): Vortrag "Forecasting seasonal time series data. A Bayesian model averaging approach", 23.04.2013.

M. Yang (Mathematics, Statistics, and Computer Science Department, University of Illinois at Chicago, USA): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 16.07.2013.

A. Zhigljavsky (School of Mathematics, Cardiff University, Großbritannien): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 20.03.-22.03.2013.

SFB-Akademie

Im Rahmen der SFB-Akademie fand am 7. und 8. Oktober 2013 der Workshop *Berufs- und Karriereplanung für Promovenden* statt. Neben der Karriereplanung ging es insbesondere um die Vermittlung aktueller Bewerbungsstandards und die Entwicklung von Bewerbungsstrategien.

Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

12th Workshop on Quality Improvement Methods, 31.05.-01.06.2013, nh Hotel Dortmund.

Organisation: A. Wilk, J. Kunert und C. Weihs (alle C2).

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

New Developments in Econometrics and Time Series, 12.09.-13.09.2013, ECARES - Solvay Brussels School of Economics and Management, Belgien.

Organisation: H. Dette (A1, C1, C2), D. Giannone, M. Hallin (C1) und S. Hörmann.

http://www.ecares.org/index.php?option=com_events&task=view_detail&agid=925&

German-Polish Joint Conference on Probability Theory and Mathematical Statistics, 06.06.-09.06.2013, Faculty of Mathematics and Computer Science of the Nikolaus-Kopernikus-Universität, Torun, Polen.
Organisation: H. Dehling (C3, C5) und A. Jakubowski.
<http://www.gpps.umk.pl/?q=node/6>



Die erste *German-Polish Joint Conference on Probability and Mathematical Statistics* (GPPS) fand vom 6. bis 9. Juni 2013 an der Nikolaus-Kopernikus-Universität Torun in Polen statt. Neben vier Plenar-Vorträgen von herausragenden Wissenschaftlern aus Leiden, London, Paris und Zürich wurden in 20 Sessions, welche jeweils von einem Organisatoren-Paar aus Polen und Deutschland organisiert wurden, insgesamt 80 eingeladene Vorträge präsentiert. Darüber hinaus gab es 120 weitere Vorträge, 15 Poster und ein exzellentes kulturelles Rahmenprogramm inklusive einem Klavierkonzert in der Toruner Altstadt, welche zum Weltkulturerbe der UNESCO zählt. Die Konferenz wurde von 273 Wahrscheinlichkeitstheoretikern und Statistikern besucht.

Kommt noch:

13th Workshop on Quality Improvement Methods, 20.06.-21.06.2014, Dortmund.
Organisation: S. Herbrandt (B4), C. Weihs (B3, B4, C2), Ch. H. Müller (B5) und J. Kunert (C2).

2nd Workshop on Methods and Challenges in Financial Risk Management (gemeinsam mit dem SFB 649), 18.-20.05.2014, Kloster Drübeck (Harz).
Organisation: W. Krämer (A1).

Diskussionspapiere

- 36/13 D. Bostandzic, G. N. F. Weiß (A7): Why do U.S. banks contribute more to global systemic risk?
- 35/13 H. Tauchmann (A3): Lee's treatment effect bounds for non-random sample selection - an implementation in Stata.
- 34/13 M. Hallin (C1), R. van den Akker und B. J. M. Werker: On quadratic expansions of log-likelihoods and a general asymptotic linearity result.
- 33/13 P. Preuß, R. Puchstein und H. Dette (alle C1): Detection of multiple structural breaks in multivariate time series.
- 32/13 R. Keller und C. Vance (A3): Landscape pattern and car use: Linking household data with satellite imagery.
- 31/13 S. Glaser (C5): A law of large numbers for the power variation of fractional Lévy processes.
- 30/13 G. N. F. Weiß (A7), D. Bostandzic und F. Irresberger: Catastrophe bonds and systemic risk.
- 29/13 D. Ziggel, T. Berens, G. N. F. Weiß (A7) und D. Wied (A1): A new set of improved value-at-risk backtests.
- 28/13 A. Bücher (A7), S. Jäschke und D. Wied (A1): Nonparametric tests for constant tail dependence with an application to energy and finance.
- 27/13 P. Messow: Discriminating between GARCH and stochastic volatility via nonnested hypotheses testing.
- 26/13 G. N. F. Weiß (A7) und J. Mühlnickel: Why do some insurers become systemically relevant?
- 25/13 A. Bücher (A7) und I. Kojadinovic: A dependent multiplier bootstrap for the sequential empirical copula process under strong mixing.
- 24/13 C. Meine, H. Supper und G. N. F. Weiß (A7): Is tail risk priced in credit default swap premia?
- 23/13 H. Polattimur (A4): Housing, collateral constraints, and fiscal policy.
- 22/13 C. Drinkuth und M. Arnold (A1): Asymptotics of improved generalized moments estimators for spatial autoregressive error models.
- 21/13 T. Berens, G. N.F. Weiß (A7) und Dominik Wied (A1): Testing for structural breaks in correlations: Does it improve Value-at-Risk forecasting?
- 20/13 M. Bibinger und M. Vetter (A1): Estimating the quadratic covariation of an asynchronously observed semimartingale with jumps.
- 19/13 T. Berens, D. Wied (A1) und D. Ziggel: A completely automated optimization strategy for global minimum-variance portfolios based on a new test for structural breaks.

- 18/13 T. A. Schmitt, R. Schäfer, D. Wied (A1) und T. Guhr: Spatial dependence in stock returns - Local normalization and VaR forecasts.
- 17/13 A. Bücher (A7): A note on weak convergence of the sequential multivariate empirical process under strong mixing.
- 16/13 M. Vetter (A1): Inference on the Levy measure in case of noisy observations.
- 15/13 H. Dehling (C3), R. Fried (C3), I. Garcia und M. Wendler (C3): Change-point detection under dependence based on two-sample U-Statistics.
- 14/13 M. Hallin (C1) und C. Mehta: R-estimation for asymmetric independent component analysis.
- 13/13 E. Paparoditis und P. Preuß (C1): On local power properties of frequency domain based tests for stationarity.
- 12/13 M. Hallin (C1), D. Paindaveine und T. Verdebout: Efficient R-estimation of principal and common principal components.
- 11/13 M. Hallin (C1), Y. Swan und T. Verdebout: On Hodges and Lehmann's $6/\pi$ result.
- 10/13 M. Hallin (C1) und M. Lippi: Factor models in high-dimensional time series - A time-domain approach.
- 09/13 K. Sen (A1), P. Preuß (C1) und H. Dette (A1): Measuring stationarity in long-memory processes.
- 08/13 T. Hildebrandt (C4), N. Bissantz (C4) und H. Dette (C1): Additive inverse regression models with convolution-type operators.
- 07/13 B. Berghaus und A. Bücher (beide A7): Nonparametric tests for tail monotonicity.
- 06/13 H. Dehling (C3), A. Rooch (C3) und M. S. Taqqu: Power of change-point tests for long-range dependent data.
- 05/13 H. Dette (C2), L. Hoyden (B1), S. Kuhnt (B1) und K. Schorning (C2): Optimal designs for additional day effects in generalized linear models with gamma distributed response.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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