

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

Ausgabe 11

Sprecher: Prof. Dr. Walter Krämer
Geschäftsstelle: Melanie Große
Geschäftsführung: Dr. Thorsten Ziebach

Technische Universität Dortmund
Fakultät Statistik
Institut für Wirtschafts- und Sozialstatistik
D-44221 Dortmund

Telefon: 0231 / 755-3125
Fax: 0231 / 755-5284
e-Post: walterk@statistik.tu-dortmund.de

Info-Brief



SFB
823

Liebe Mitglieder des SFB 823,

in diesem Juli ist die Hälfte unserer maximalen Laufzeit um. Eigenlob stinkt, ich weiß, aber wenn ich mir diesen Infobrief und seine Vorgänger ansehe, dann haben wir in dieser Hälfte vielleicht sogar schon mehr produziert als manche verwandte Forschungsverbände in zwölf Jahren. Zumindest fehlt es nicht an Anerkennung, wobei es mich besonders freut, dass ab diesem Jahr zwei weitere bekannte Fachzeitschriften einen Chefherausgeber aus dem Kreis unserer Projektleiter und Projektleiterinnen erhalten werden (von den zahlreichen von SFB-Mitgliedern ausgeübten Funktionen als Mitherausgeber oder sonstiges Mitglied des Herausgebergremiums ganz zu schweigen). Da wissenschaftliche Fachjournale inzwischen ja wohl die wichtigste Plattform zur Popularisierung und Verbreitung neuer Forschungsideen sind, befinden wir uns damit also in mehrfacher Hinsicht und etwas salopp gesprochen mitten im Gewühl.

Ich nehme an, Sie alle haben sich den 1. und 2. Oktober dieses Jahres schon gut vorgemerkt (wenn nicht, bitte sofort nachholen)? Da treffen wir uns zur nächsten Klausurtagung in Lüdenscheid und werden uns gegenseitig zeigen, dass wir nicht wie Bayern München nach einer starken ersten Saisonhälfte müde werden. Wir wollen das Triple, die dritte Runde, und stellvertretend für meine Trainerkollegen im Vorstand erlaube ich mir den Appell: Auf geht's Leute, auch der Beste (die Beste) kann noch besser werden.

Ihr SFB-Sprecher Walter Krämer

Rufe, Ehrungen und Preise

Herold Dehling (C1, C3) ist seit dem 01.04.2015 neuer Editor-in-Chief von *Stochastic Processes and their Applications*.

Holger Dette (A1, C1, C2) wurde zum Fellow der *American Statistical Association* und zum Editor-in-Chief von *Bernoulli* gewählt.

Roland Fried (B6, C3) hat den Preis für die beste Lehre 2014 der Fachschaft Statistik erhalten.

Walter Krämer (A1, Z) ist erster Träger des Gerhart-Bruckmann-Preises der Österreichischen Statistischen Gesellschaft.

Alexander Paduch (C5) hat den Frommknechtpreis 2014 für die Masterarbeit "Untersuchung negativer Abhängigkeit mit Tail Copulas" erhalten.

Christoph M. Schmidt (A3) wurde im November 2014 ins acatech-Präsidium gewählt.

Alexander Schnurr (C5) hat einen Ruf auf die W2-Professur "Stochastik" an der Universität Siegen erhalten.

Gregor Weiß (A7) belegte beim Handelsblatt-Ranking 2014 der forschungstärksten deutschsprachigen BWL-Professoren in der Kategorie *Forscher unter 40* den 66. Platz.

Martin Wendler (C1, C3) hat einen Ruf auf eine Juniorprofessur für Stochastik an der Universität Greifswald erhalten und angenommen.

Allen Berufenen und Geehrten einen herzlichen Glückwunsch!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

T. Berens, G. Weiß (A7) und D. Wied (A1): Testing for Structural Breaks in Correlations: Does it Improve Value-at-Risk Forecasting?, erscheint in: *Journal of Empirical Finance*.

N. Bissantz (C4), H. Dette (A1, C1, C2) und T. Hildebrandt (C1): Smooth backfitting in additive inverse regression, erscheint in: *Annals of the Institute of Statistical Mathematics*.

A. Bücher (A7) und I. Kojadinovic: A dependent multiplier bootstrap for the sequential empirical copula process under strong mixing, erscheint in: *Bernoulli*.

H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und R. Guchenko: T -optimal discriminating designs, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Dette (A1, C1, C2) und D. Wied (A1): Detecting relevant changes in time series models, erscheint in: *Journal of the Royal Statistical Society, Ser. B*.

H. Elsaied und R. Fried (B6, C3): Tukey's M-estimator of the Poisson parameter with a special focus on small means, erscheint in: *Statistical Methods and Applications*.

M. Frondel, S. Sommer und C. Vance (alle A3): The Burden of Germany's Energy Transition: An Empirical Analysis of Distributional Effects, erscheint in: *Economic Analysis and Policy*.

C. Gerstenberger (C3) und D. Vogel: On the efficiency of Gini's mean difference, erscheint in: *Statistical Methods and Applications*.

T. Kley (C1): Quantile-Based Spectral Analysis in an Object-Oriented Framework and a Reference Implementation in R: The quantspec Package, erscheint in: *Journal of Statistical Software*.

T. Kley (C1), S. Volgushev (A1), H. Dette (A1, C1, C2) und M. Hallin: Quantile spectral processes: Asymptotic analysis and inference, erscheint in: *Bernoulli*.

M. Konstantinou (C2), S. Biedermann und A. C. Kimber: Optimal designs for full and partial likelihood information with application to survival models, erscheint in: *Journal of Statistical Planning and Inference*.

K. Kraft (A5), K. Aerts und J. Lang (A5): Profit sharing and innovation, erscheint in: *Industrial and Corporate Change*.

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

C. Meine, H. Supper und G. Weiß (alle A7): Do CDS spreads move with commonality in liquidity?, erscheint in: *Review of Derivatives Research*.

C. Meine, H. Supper und G. Weiß (alle A7): Is Tail Risk Priced in Credit Default Swap Premia?, erscheint in: *Review of Finance*.

R. Puchstein und P. Preuß (beide A1, C1): Testing for stationarity in multivariate locally stationary processes, erscheint in: *Journal of Time Series Analysis*.

T. Schmitt, R. Schäfer, D. Wied (A1) und T. Guhr: Spatial dependence in stock returns - Local normalization and VaR forecasts, erscheint in: *Empirical Economics*.

K. Sen (A7), P. Preuss (A1) und H. Dette (A1, C1, C2): Measuring stationarity in long-memory processes, erscheint in: *Statistica Sinica*.

M. Wagner (A3, A4) und J. Hlouskova: Growth Regressions, Principal Components Augmented Regressions and Frequentist Model Averaging, erscheint in: *Journal of Economics and Statistics (Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik)*.

G. Weiß und J. Mühlnickel (beide A7): Consolidation and Systemic Risk in the International Insurance Industry, erscheint in: *Journal of Financial Stability*.

D. Wied (A1): A Nonparametric Test for a Constant Correlation Matrix, erscheint in: *Econometric Reviews*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

M. Andor, M. Frondel und C. Vance (alle A3): Hypothetische Zahlungsbereitschaft für grünen Strom: Bekundete Präferenzen privater Haushalte für das Jahr 2013, *Perspektiven der Wirtschaftspolitik* 15 (4), 1-12 (2014).

P. Aschersleben, M. Wagner (A3, A4) und D. Wied (A1): Monitoring Euro Area Real Exchange Rates, *Springer Proceedings in Mathematics and Statistics* 122, 363-370 (2015).

C. Bierth, F. Irresberger und G. Weiß (alle A7): Systemic Risk of Insurers Around the Globe, *Journal of Banking and Finance* 55, 232-245 (2015).

A. Bücher (A7), S. Jäschke und D. Wied (A1): Nonparametric Tests for Constant Tail Dependence With an Application to Energy and Finance, *Journal of Econometrics*, 187 (1), 154-168 (2015).

J. Dedecker, H. Dehling (C1, C3) und M. S. Taqqu: Weak convergence of the empirical process in L^2 under Long-range dependence, *Stochastics and Dynamics* 15 (2) (2015).

H. Dette (A1, C1, C2), M. Hallin, T. Kley (C1) and S. Volgushev (A1): Of quantiles, ranks, and spectra: An L_1 approach to spectral analysis, *Bernoulli* 21 (2), 781-831 (2015).

H. Dette (A1, C1, C2) und C. Kiss (C2): Optimal designs for rational regression models, *Journal of Statistical Theory and Practice*, 9 (2), 376-394 (2015).

H. Dette (A1, C1, C2) und J. Kunert (C2): Optimal Designs for the Michaelis Menten Model with Correlated Observations, *Statistics* 48, 1254-1267 (2014).

H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: 'Nearly' universally optimal designs for models with correlated observations, *Computational Statistics and Data Analysis* 71, 1103-1112 (2014).

H. Dette (A1, C1, C2), R. Van Hecke und S. Volgushev (beide C1): Some comments on copula-based regression, *Journal of the American Statistical Association* 109 (507), 1319-1324 (2014).

H. Dette (A1, C1, C2) und M. Vogt: Detecting gradual changes in locally stationary processes, *Annals of Statistics* 43 (2), 713-740 (2015).

A. Dürre (C3), R. Fried (B6, C3) und T. Liboschik (C3): Robust estimation of (partial) autocorrelations, *WIREs Computational Statistics* 7 (3), 205-222 (2015).

A. Dürre, D. Vogel (beide C3) und R. Fried (B6, C3): Spatial sign correlation, *Journal of Multivariate Analysis* 135, 89-105 (2015).

S. Fischer und A. Schumann (beide B6): Comment on the paper of Willems, P.: Multidecadal oscillatory behaviour of rainfall extremes, *Europe Climatic Change* 120 (4), 931-944 (2015).

M. Kansteiner und D. Biermann (beide B4): Materialabtrag – TU Dortmund untersucht die Materialabtragsvorgänge bei der Bearbeitung von Stahlbeton, *Der Betonbohrer – Fachzeitschrift für Diamanttechnik* 36 (1), 46-49 (2015).

M. Kansteiner und D. Biermann (beide B4): Ritzversuche auf mehrphasigen Werkstoffen mit unterschiedlicher Kornausrichtung, *Diamond Business* 52 (1), 50-60 (2015).

W. Krämer (A1, Z): Zur Ökonomie von Panik, Angst und Risiko, *Perspektiven der Wirtschaftspolitik* 15, 367-377.

P. L. Pedroni, T. J. Vogelsang, M. Wagner (A3, A4) und J. Westerlund: Nonparametric Rank Tests for Non-Stationary Panels, *Journal of Econometrics* 185, 378-391 (2015).

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

M. Scheffer und G. Weiß (A7): Mixture Pair-Copula-Constructions, *Journal of Banking and Finance* 54, 175-191 (2015).

K.F. Siburg, P. Stoimenov und G. Weiß (A7): Forecasting Portfolio-Value-at-Risk with Nonparametric Lower Tail Dependence Estimates, *Journal of Banking and Finance* 54, 129-140 (2015).

M. Schulte und A. Schumann (beide B6): Downstream-directed performance assessment of reservoirs in multi-tributary catchments by application of multivariate statistics, *Water Resources Management* 29, 419-430 (2014).

C. Vance und N. Ritter (beide A3): Is Peace a Missing Value or a Zero?, *Journal of Peace Research* 51 (4), 528-540 (2014).

S. Volgushev (A1) und X. Shao: A general approach to the joint asymptotic analysis of statistics from sub-samples, *Electronic Journal of Statistics* 8, 390-431 (2014).

S. Volgushev (A1), J. Wagener (A1, C1) und H. Dette (A1, C1, C2): Censored quantile regression processes under dependence and penalization, *Electronic Journal of Statistics* 8 (2), 2405-2447 (2014).

A. Wilk und J. Kunert (C2): Optimal crossover designs in a model with self and mixed carryover effects with correlated errors, *Metrika* 78, 161-174 (2015).

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

B. Hussong (B1), V. Lünemann und W. Tillmann (B1): Investigation of the interface of overlapping splats for a WC-based Cermet, Proceedings of International Thermal Spraying Conference, Long Beach, Kalifornien, U.S.A., 11.-14.05.2015.

R. Martin (B3), M. Azarpour und G. Enzner: Binaural Speech Enhancement with instantaneous Coherence Smoothing Using the Cepstral Correlation Coefficient, Proceedings IEEE International Conference Acoustics, Speech, and Signal Processing (ICASSP), Brisbane, Australien (2015).

Ch. M. Schmidt (A3): Die Energiewende europäisch integrieren. Neue Gestaltungsmöglichkeiten für die gemeinsame Energie- und Klimapolitik. Schriftenreihe zur wissenschaftsbasierten Politikberatungacatech, Leopoldina und Akademienunion, München (2014).

3) Populärwissenschaftliche Texte

H. Dette (A1, C1, C2) und K. Schorning (C2): Medikamentenstudien: Mit Mathe die optimale Dosis finden, *RUBIN Wissenschaftsmagazin*.

M. Frondel (A3): Versorgungssicherheit mit Strom: Kann der Markt es richten?, *WiSt Wirtschaftswissenschaftliches Studium Zeitschrift für Studium und Forschung* 44 (4), 175 (2015).

M. Frondel (A3): Ölmarkt: Niedrige Preise – ein Wunder?, *Wirtschaftsdienst* 95 (2), 84-85 (2015).

4) Medienbeiträge

M. Frondel (A3): Geht der Welt wirklich das Öl aus?, *detektor fm*, 10.04.2015.
<http://detektor.fm/wirtschaft/energiewirtschaft-erdoel-suedengland-entdeckt>

M. Frondel (A3): Vier Jahre nach Fukushima: Die Sicherheit der Energieversorgung in Europa, *Deutschlandfunk*, 11.03.2015.
http://www.deutschlandfunk.de/vier-jahre-nach-fukushima-die-sicherheit-der.2011.de.html?dram:article_id=313874

W. Krämer (A1, Z): Panik ist ein gutes Geschäftsmodell, *DiePresse.com*, 26.09.2014.
http://diepresse.com/home/wirtschaft/economist/3876095/Okonom-Kraemer_Panik-ist-ein-gutes-Geschaeftsmodell

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

W. Krämer (A1, Z): Deutschland haftet jetzt schon mit mehr als 500 Milliarden Euro, *Focus-Money*, 13.11.2014.

http://www.focus.de/finanzen/boerse/experte-walter-kraemer-im-interview-deutschland-haftet-jetzt-schon-mit-mehr-als-500-milliarden-euro_id_4268024.html

W. Krämer (A1, Z): Deflation noch weit weg. *Focus 5/2015*.

Ch. M. Schmidt (A3): Mögliches Ausscheiden Griechenlands aus dem Euro. Interview in ARD plusminus, Januar 2015.

Ch. M. Schmidt (A3) und M. Fratzscher (2015): Unternehmer sind nicht doof - Streitgespräch zur Standortpolitik, *Wirtschaftswoche*, 05.01.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Keine gute Entscheidung der EZB, Interview in *Wirtschaftswoche online*, 22.01.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Die Machtprobe: Tsipras gegen das alte Europa, Studiogast bei *Anne Will (ARD)*, 04.02.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Griechenland spielt mit dem Feuer, *Westfalenpost / WAZ*, 09.04.2015.

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

W. Krämer (A1, Z): Statistisches Innumeratentum: Woher es kommt, wie es sich manifestiert und was man dagegen tut. Jahresversammlung der Österreichischen Statistischen Gesellschaft, Wien, 14.04.2015.

W. Krämer (A1, Z): Wahrheiten suchen mit Statistik: Wie man mit Daten umgeht und wie nicht. Berliner Tag der Mathematik, Beuth Hochschule für Technik, 09.05.2015.

A. Schumann (B6): Bemessungshochwasser – eine Frage der mathematischen Statistik?, Österreichische Gesellschaft f. Hydrologie, Wien, Österreich, 26.02.2015.

M. Wagner (A3, A4): Some Extensions of Regression Based Cointegration Analysis, 8th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

2) Sonstige Vorträge auf Konferenzen

B. Berghaus (A7): Goodness-of-fit tests for multivariate copulas under strong mixing based on a dependent multiplier bootstrap, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

N. Bissantz (C4): Detecting time-dependency in live cell-imaging, 61. Biometrisches Kolloquium, Dortmund, 15.-18.03.2015.

- J. Buchsteiner (C1): Asymptotics of plug-in estimators under long-range dependence, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.
- A. Bücher (A7): Extreme-value copula estimation based on block maxima of a multivariate stationary time series, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.
- A. Bücher (A7): Weak convergence of empirical copula processes with respect to weighted supremum distances, Oberwolfach Conference Copulae: On the Crossroads of Mathematics and Economics, Oberwolfach, 13.-17.04.2015.
- H. Dehling (C1, C3): Robust change-point tests for time series, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.
- H. Dette (A1): Detection of multiple structural breaks in multivariate time series, Waseda International Symposium "Asymptotic Sufficiency, Asymptotic Efficiency and Semimartingale", Waseda University, Tokyo, Japan, 02.-04.03.2015.
- K. Dyballa (A5): Does Codetermination Affect the Composition of Variable versus Fixed Parts of Executive Compensation? – An Empirical Analysis for Listed Companies in Germany, Workshop on Co-Determination, IAAEU Trier, 28.-29.11.2014.
- S. Fischer (B6): A Robust Estimator of the Tail Index under Short Range Dependence, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.
- S. Fischer (B6): Robuste Hochwasserstatistik- Eine Anwendung des POT-Verfahrens, Abschlussworkshop Robust Risk Estimation, Fraunhofer ITWM, Kaiserslautern, 20.02.2015.
- J. Franke (A5): Workers' Participation in Wage Setting and Opportunistic Behavior: Evidence from a Gift-Exchange Experiment, Workshop on Co-Determination, IAAEU Trier, 28.-29.11.2014.
- R. Fried (B6, C3): Multivariate Extremwertstatistik in der Hydrologie, Abschlussworkshop Robust Risk Estimation, ITWM Kaiserslautern, 20.02.2015.
- R. Fried (B6, C3), K. Fokianos, T. Liboschik (C3): An R package for the analysis of outliers and interventions in count time series, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, 06.-08.12.2014.
- M. Frondel (A3): Hypothetische Zahlungsbereitschaft für grünen Strom: Bekundete Präferenzen privater Haushalte für das Jahr 2013, 9. Internationale Energie-wirtschaftstagung (IEWT 2015), Wien, Österreich, 11.-13.02.2015.
- M. Frondel (A3): From Fuel Taxation to Efficiency Standards: A Wrong Turn in European Climate Protection?, 14th IAEE European Energy Conference (IAEE EU), Rom, Italien, 28.-31.10.2014.
- P. Grabarczyk (A3): Integrated Modified OLS Estimation for Cointegrating Polynomial Regressions with an Application to the EKC, 8th International

Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

B. Hussong (B1), V. Lünemann und W. Tillmann (B1): Investigation of the interface of overlapping splats for a WC-based Cermet, International Thermal Spraying Conference and Exposition, Long Beach, Kalifornien, U.S.A., 11.- 14.05.2015.

K. Kettelhake (C2): Designing dose finding studies with an active control for exponential families, 61. Biometrisches Kolloquium, Dortmund, 15.-18.03.2015.

P. Kinsvater (B6): Strukturbrüche in der Abhängigkeit multivariater Extremwertverteilungen, ITWM Kaiserslautern Abschlussworkshop Robust Risk Estimation, 20.02.2015.

T. Kley (C1): Quantile-based spectral analysis: asymptotic theory and computation, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

S. Kuhnt, N. Rudak (beide B1) und E. Riccomagno: Identifiability of regression models from noisy design by numerical algebraic fans, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

J. Kunert (C2): On optimal crossover designs in a model with carryover effects which are proportional to direct effects, 12th Workshop on Stochastic Models, Statistics and their Applications, Wroclaw, Polen, 16.-20.02.2015.

T. Liboschik (C3), K. Fokianos und R. Fried (B6, C3): Monitoring of count time series following generalized linear models, 61. Biometrisches Kolloquium, Dortmund, 15.-18.03.2015.

J. Lilienthal (B6): Homogenitätstests bei Daten mit räumlicher Abhängigkeit, Abschlussworkshop Robust Risk Estimation, ITWM Kaiserslautern 20.02.2015.

Ch. H. Müller (B5): Data depth for autoregression with application to crack growth, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

A. Nagathil, C. Weihs und R. Martin (alle B3): Towards Improved Music Perception in the Presence of a Cochlear Hearing Loss by Using Reduced-Rank Approximations of Music Signals, Erlanger Kolloquium, 26.02.2015.

A. Nagathil, C. Weihs und R. Martin (alle B3): Signal Processing Strategies for Improving Music Perception in the Presence of a Cochlear Hearing Loss, Jahrestagung der Deutschen Gesellschaft für Audiologie (DGA), Bochum, 04.-07.03.2015.

K. Proksch (C4): Simultaneous Confidence Bands in Nonparametric Regression - With Applications to Image Analysis, Workshop on Stochastic Models, Statistics and Their Applications (SMSA) 2015, Wroclaw, Polen, 19.02.2015.

A. Rehage und S. Kuhnt (beide B1): An angle-based functional depth measure for shape outlier detection, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

A. Schnurr (C5): Detecting Changes in the Dependence Structure between Two Time Series, AMS Sectional Meeting, East Lansing, U.S.A., 14.-15.03.2015.

K. Schorning (C2): Optimal designs for comparing curves, 61. Biometrisches Kolloquium, Dortmund, 15.-18.03.2015.

A. Schumann (B6): Statistische Probleme in der Hochwasserhydrologie, Abschlussworkshop Robust Risk Estimation, Fraunhofer ITWM, Kaiserslautern, 20.02.2015.

O. Stypka (A3): Testing for smooth transition cointegration with integrated or trending transition variable, 8th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

C. Vance (A3): Do Major Brands Have Market Power in German Retail Gas Market?, 94th Annual Meeting of the Transportation Research Board (TRB 2015), Washington, D.C., U.S.A., 11.-15.01.2015.

M. van Kampen (A1): Convergence Rates of Sieve Estimators of Nonlinear Cointegration Models, 8th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

S. Volgushev (A1): Quantile Spectral Analysis, Waseda International Symposium "Asymptotic Sufficiency, Asymptotic Efficiency and Semimartingale", Waseda University, Tokyo, Japan, 02.-04.03.2015.

S. Volgushev (A1): A fast subsampled bootstrap for large time series, Miura Statistical Seminar, Tokyo, Japan, 05.03.2015.

M. Wagner (A3, A4): Monitoring stationarity and cointegration, 6th Italian Conference on Econometrics and Empirical Economics, University of Salerno, Italien, 21.01.-23.01.2015 (auch: 12th Workshop on Stochastic Models, Statistics and their Applications, Wroclaw, Polen, 16.02.-20.02.2015).

G. Weiß (A7): Dynamic Dependence in Prices, Liquidity, and Credit Risk, 8th Financial Risks International Forum 2015, Paris, Frankreich, 30.-31.03.2014.

M. Wendler (C1, C3): Nonparametric method for change point detection in functional time series, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

D. Wied (A1): Monitoring a Change from Spurious Regression to a Cointegrating Relationship, 8th International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

D. Wied (A1): Detecting Relevant Changes in Time Series Models, Workshop Short and Long Memory in Probability and Statistics, Ruhr-Universität Bochum, 16.+17.01.2015.

M. Wornowizki (C3): Nonparametric two-sample tests based on divergences with attention to extreme values, 7th International Conference on Computational and Methodological Statistics (ERCIM 2014), Pisa, Italien, 06.-08.12.2014.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren

M. Andor (A3): Eliciting the Willingness to Pay for Electricity from Renewables, Nuclear and Conventional Energies – Results from a Large Field Study in Germany, Research Seminar on Environment, Resource and Climate Economics, TU Berlin, Berlin, 05.12.2014.

H. Dette (A1, C1, C2): Quantile based spectral analysis, Department of Statistics, University of California Berkeley, U.S.A., 08.10.2014 (auch: Department of Statistics, University of California, Davis, U.S.A., 09.10.2014; Department of Statistics, University of California, Los Angeles, U.S.A., 14.10.2014; Nanyang Technological University, Singapore, Januar 2015).

F. Dunker (C4): Nonparametric Estimation of Coefficients in Stochastic Differential Equations by Penalized Maximum Likelihood, Institut für Angewandte Mathematik, Westfälische Wilhelms-Universität Münster, 14.01.2015.

F. Dunker (C4): Nonparametric Identification of Endogenous and Heterogeneous Discrete Choice Models, Volkswirtschaftliche Fakultät, Ludwig-Maximilians-Universität München, 16.03.2015 (auch: Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät, Humboldt-Universität Berlin, 27.04.2015).

R. Fried (B6, C3): On outliers and shifts in time series, Institute for Complex Systems and Mathematical Biology (ICSMB), University of Aberdeen, Schottland, 11.03.2015.

F. Irresberger (A7): Depositor Sentiment, Brown Bag Seminar Rheinisch-Westfälisches Institut für Wirtschaftsforschung Brown Bag Seminar, Essen, 04.11.2014 (auch: Doktorandenkolloquium Lehrstuhl für Investition und Finanzierung, Universität Paderborn, 13.11.2014 und Institut für Wirtschaftsforschung Halle (Saale), 20.03.2014).

T. Kley (C1): Quantile-Based Spectral Analysis of Time Series, Mathematical Sciences Colloquium, Michigan Technological University, Houghton, U.S.A., 20.03.2015.

W. Krämer (A1): Statistical Illiteracy. Where it comes from and what to do about it, Eurostat, Luxemburg, 23.03.2015.

A. Schnurr (C5): On the Spectrum of Applications of the Probabilistic Symbol, Mathematische Fakultät, Universität Aarhus, Dänemark, 19.02.2015.

A. Schnurr (C5): On the Natural Appearance of Continuous Negative Definite Functions in the Analysis of Stochastic Processes, Universität Freiburg, 23.04.2015.

S. Volgushev (A1): Quantile-based spectral Analysis, Department of Statistical Sciences, Cornell University, Ithaca, U.S.A., 14.01.2015 (auch: Department of Statistics, University of Michigan, Ann Arbor, U.S.A., 20.01.2015).

M. Wagner (A3, A4): Some Extensions of Regression Based Cointegration Analysis: Theory for Applications, Humboldt-Universität zu Berlin, 24.11.14 (auch Universität Leipzig, 26.11.2014).

M. Wagner (A3, A4): Some Extensions of Regression Based Cointegration Analysis: Theory for Applications, Department of Economics, Universität Bern, Schweiz

02.03.15 (auch: Department of Mathematics, Universität Ljubljana, Slowenien, 05.03.15; CentER, Tilburg University, Niederlande 11.03.15).

D. Wied (A1): Detecting Relevant Changes in Time Series Models, Humboldt-Universität Berlin, 22.10.2014.

D. Wied (A1): Rotating Lecture für die 11. Kohorte der RGS Econ, Essen, 14.11.2014.

D. Wied (A1): Lohnverteilungen mit Mindestlohn: Distributional Regression und Spezifikationstests, Universität Bielefeld, 16.01.2015.

D. Wied (A1): Misspecification Testing in a Class of Conditional Distributional Models, IHS Wien, 29.01.2015.

D. Wied (A1): Testing for Constant Dependence Structure of Asset Returns, Universität Hamburg, 08.04.2015.

D. Wied (A1): Lohnverteilungen mit Mindestlohn: Distributional Regression und Spezifikationstests, Universität Hannover, 15.04.2015.

D. Wied (A1): Testing for Constant Dependence Structure of Asset Returns, Zeppelin Universität Friedrichshafen, 20.04.2015.

J. Woerner (C5): Inference for stochastic volatility models with jumps, Mathematisches Kolloquium, Universität Augsburg, 04.11.2014.

J. Woerner (C5): Continuous-time moving average processes: Modelling and Statistics, Mathematisches Kolloquium, Universität zu Lübeck, 06.05.2015.

4) Poster

A. Nagathil (B3), K. Neumann, J.-W. Schlattmann, A. Engel, S. Dazert und R. Martin (B3): Ein Modell zur Vorhersage von Musikbewertungen durch Cochlea-Implantat-Träger, MED-EL Workshop, Kitzbühel, Österreich, 24.04.2015.

5) Software

T. Liboschik (C3), R. Fried (B6, C3), K. Fokianos und P. Probst: tscout: Analysis of Count Time Series. R package version 1.0.0 (2015).

6) Sonstige Vorträge

Ch. H. Müller (B5): Vom Pastor Bayes im 18ten Jahrhundert zum Smartphone, Dortmunder Tag der Statistik (DOTS 2015), 10.2.2015.

K. Proksch (C4): Monitoring of significant changes over time in fluorescence microscopy imaging of living cells, Universität Hamburg, 23.04.2015.

Abschlussarbeiten

- E. Bednarz (A7): Prognostizierbarkeit von Herdenverhalten mithilfe von Internetsuchdaten, TU Dortmund, Fakultät WiSo, 09.03.2015.
- R. Brandt (A7): Bankeinlagen, Anlegerverhalten und die Vorhersagbarkeit von Schalterstürmen, TU Dortmund, Fakultät WiSo, 19.12.2014.
- D. Friebe (B6): Uni- und multivariate Analysen von Messwerten der Talsperrenüberwachung unter Berücksichtigung von Bruchpunkten am Beispiel der Ennepetalsperre, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Bau- und Umweltingenieurwissenschaften, 14.04.2015.
- Y. Ha (A7): The 2008 Short Selling Ban and Systemic Risk, TU Dortmund, Fakultät WiSo, 12.01.2015.
- J. Haring (A1): Erkennung von Strukturbrüchen in den Randabhängigkeiten stündlich vorliegender Energiedaten, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 10.10.2014.
- M. Kipp (B4): Grundlagenuntersuchungen der Materialtrennung metallischer und mineralischer Werkstoffe auf Mikroebene. Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Maschinenbau, Februar 2015.
- F. Kövener (A7): Eine empirische Analyse der Determinanten von CDS-Spreads, TU Dortmund, Fakultät WiSo, 08.12.2014.
- J. Lameyer (A7): Co-Attention, Co-Sentiment, and Stock Liquidity, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 13.01.2015.
- A. Lammers (A5): Die Determinanten und Auswirkungen freiwilliger Mitbestimmungsgremien – Eine empirische Analyse, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Wirtschafts- und Sozialwissenschaften, 06.10.2014.
- R. Löser (A1): Hochdimensionale Value-at-Risk-Backtests, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 13.01.2015.
- K. Musielak (C5): Pfadverhalten Markovscher Semimartingale, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 20.04.2015.
- S. Neumärker (A1): Scheinbar langes Gedächtnis bei GARCH-Prozessen Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 12.01.2015.
- Th. V. Schnober (A1): Schätzung von Strukturbrüchen in Saisonmustern makroökonomischer Zeitreihen, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 20.10.2014.
- D. Tomecki (A1): Grenzwertsätze für zufällige Momentenfolgen, Masterarbeit, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, April 2015.
- K. Warkentin (A1): Simulationen eines neuen Tests auf relevante Strukturbrüche in Zeitreihen, Diplomarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 22.02.2014.
- J. Wiedom (B5): Vergleich von Bayesianischen nichtlinearen und nichtlinearen hierarchischen Mischungsmodellen für die Ausbreitung von Rissen in Stahlproben, Masterarbeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 11.12.2014.

Promotionen

I. Burghaus (C2): Versuchsplanung bei nicht-konkaven Optimalitätskriterien, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 17.12.2014.

M. Schulte (B6): Anwendung von Copula-Modellen in der Hochwasserstatistik zur Planung technischer Rückhaltemaßnahmen, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 02.03.2015.

Habilitationen

N. Bissantz (C4): 28.01.2015, Ruhr-Universität Bochum (Mathematik).

A. Schnurr (C5): 11.02.2015, TU Dortmund (Mathematik).

Sonstiges

A. Betken (C3) hat ein Promotionsstipendium der Studienstiftung des deutschen Volkes erhalten.

R. Fried (B6, C3) ist Mitglied des wissenschaftlichen Programmkomitees der CRONoS COST Action *Computationally-intensive methods for the robust analysis of non-standard data*.

R. Fried (B6, C3) ist Mitglied des wissenschaftlichen Programmkomitees beim Workshop der ERCIM Working Group on Computing and Statistics, London, 12.-14.12.2015.

R. Fried (B6, C3) ist Mitglied des wissenschaftlichen Programmkomitees auf dem 61. Biometrischen Kolloquium, Dortmund, 15.-18.03.2015.

C. Gerstenberger (C3) hat ein Promotionsstipendium der Konrad-Adenauer-Stiftung erhalten.

K. Ickstadt (B5) ist Mitglied des Programmkomitees für das ISBA 2016 World Meeting der International Society for Bayesian Analysis auf Sardinien, Italien, 13.-17.06.2016.

G. Weiß (A7) vertritt im Sommersemester 2015 eine W2-Professur für Betriebswirtschaftslehre / Nachhaltige Finanzdienstleistungen, insb. Banken an der Universität Leipzig.

J. Woerner (C5) ist seit April 2015 Associate Editor bei *Stochastic Processes and their Applications*.

SFB-Akademie

In der Leitung der Akademie hat es einen Wechsel gegeben: Sebastian Voß hat uns zum 15. November 2014 verlassen und ein Angebot der statistischen Unternehmensberatung CHRESTOS angenommen.

Seine Aufgaben als Organisator der SFB-Akademie übernimmt Simon Neumärker aus dem Projekt A1. Er hat zum 1. Februar 2015 als wissenschaftlicher Mitarbeiter am Institut für Wirtschafts- und Sozialstatistik angefangen. Über Vorschläge und Anregungen zur konkreten Ausgestaltung des Akademieprogramms freut er sich sehr.

Folgende Themen hat er für das diesjährige Programm in die engere Auswahl genommen:

- Stimme und Sprache – Wie das Reden leichter und wirkungsvoller gelingt
- Zeitmanagement in der Promotion
- Networking für Wissenschaftler



SFB-Mitglieder unterwegs

H. Dehling (C1, C3) war vom 12.02. bis zum 20.02.2015 zu Gast an der Boston University bei Prof. Murad Taqqu zur Fortführung der gemeinsamen Forschung zu 'Statistical methods for long-range dependent data'.

M. Hoffmann (A1) hat vom 29.03. bis zum 02.04.2015 an der Spring School on Levy Processes der Universität Zürich und der ETH Zürich teilgenommen.

T. Kley (C1) hat vom 22.02. bis zum 18.03.2015 an der University of Illinois in Urbana-Champaign, U.S.A., mit Prof. Xiaofeng Shao zum Thema 'Zeitreihen' geforscht.

M. Wagner (A3, A4) war im Rahmen seines Forschungssemesters im Wintersemester 2014/15 zu Gast an der TU Wien bei Prof. Manfred Deistler.

Gastwissenschaftler

D. Bauer (Fakultät für Wirtschaftswissenschaften, Lehrstuhl für Ökonometrie, Universität Bielefeld): Vortrag "Estimating seasonally cointegrated state space systems using subspace methods", 07.04.2015.

G. Cheng (Department of Statistics, Purdue University, West Lafayette, U.S.A.): Vortrag "Nonparametric Bernstein-von Mises Phenomenon: A Tuning Prior Perspective", 27.11.-09.12.2014.

C. Dehm (Fakultät für Mathematik, Karlsruher Institut für Technologie), Vortrag: "Der Brown-Resnick Prozess", 11.03.2015.

A. C. George (Bundesinstitut für Innovation und Entwicklung des Österreichischen Schulwesens Salzburg, Österreich): Vortrag "Herausforderungen bei Gruppenvergleichen mit kognitiv diagnostischen Modellen im Large-Scale Assessment", 18.11.2014.

M. Hallin (ECARES, Université Libre de Bruxelles, Belgien): Vortrag "General dynamic factors and volatilities", 02.02.-04.02.2015.

T. Kuosmanen (School of Business, Aalto University, Helsinki, Finnland): Vortrag "Orthogonality conditions for identification of joint production technologies", 24.03.2015.

V. B. Melas (St. Petersburg State University, Russische Föderation): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 03.04.-30.04.2015.

A. Munk (Institut für Mathematische Stochastik, Georg-August-Universität Göttingen): Vortrag "Multiscale Change Point Inference", 17.04.2015.

O. Okhrin (Ladislaus von Bortkiewicz Chair of Statistics, Humboldt-Universität zu Berlin): Vortrag "Efficient Iterative Maximum Likelihood Estimation of High-Parameterized Time Series Models", 11.11.2014.

X. Pedeli (Department of Statistics, Athens University of Economics & Business, Griechenland): Vortrag "On some Multivariate Time Series Models for Count Data", 23.11.-26.11.2014.

W. F. Rosenberger (Department of Statistics, George Mason University, Fairfax, U.S.A. - Fulbright Scholar and Visiting Professor, Institut für Medizinische Statistik, RWTH Aachen): Vortrag "Randomization in Small Population Clinical Trials", 09.12.2014.

O. Roustant (Ecole des Mines de St-Etienne, Frankreich): Vortrag "Predicting on circular domains with Gaussian processes", 09.03.-12.03.2015.

O. Sharipov (National University of Uzbekistan, Tashkent): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 25.10.2014-22.01.2015.

M. S. Taqqu (Mathematics & Statistics, Boston University, U.S.A.): "Self-similar processes with stationary increments on Wiener chaos", 13.01.2015.

W. K. Wong (UCLA School of Public Health, U.S.A.): Vortrag "Optimal designs for nonlinear models", 22.03.-24.03.2015.

A. Zhigljavsky (Cardiff School of Mathematics, Cardiff University, Großbritannien): Vortrag: "Optimal designs for correlated observations using stochastic differential equations", 06.04.-09.04.2015.

Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

Short and long memory in probability and statistics – Workshop on the Occasion of Herold Dehling's 60th Birthday,

16.01.-17.01.2015, Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum.

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

http://www.statistik.tu-dortmund.de/fileadmin/user_upload/program2.pdf

<http://www.ruhr-uni-bochum.de/ffm/Lehrstuehle/Lehrstuhl-XII/index.html>



Zu dem Workshop trafen sich 51 Kolleginnen und Kollegen zu folgenden Themen: Grenzwertsätze für kurz- und langzeitabhängige Zeitreihen, empirische Prozesse, Extremwerte, Strukturbruchanalyse und nichtparametrische Verfahren. Dabei wurden sowohl wahrscheinlichkeitstheoretische Aspekte als auch die statistische Anwendung diskutiert.

DAGStat-Symposium 2015: Big Data - Big Brother oder Big Chances?

24.04.2015, Beuth Hochschule für Technik Berlin

Organisation: Ch. H. Müller (B5), H. Bömermann

Kommt noch:

14th Workshop on Quality Improvement Methods,

05.06.-06.06.2015, Hotel Esplanade, Dortmund.

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

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

5th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series,
11.06.-12.06.2015, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik.
Organisation: A. Bücher (A7), H. Dette (A1,C1,C2), M. Hallin, T. Kley und S. Volgushev
<http://www.ruhr-uni-bochum.de/mathematik3/research/sfb/workshop2015.html>

Design and Analysis of Experiments in Healthcare,
06.07.-10.07.2015, Isaac Newton Institute for Mathematical Sciences, Cambridge,
UK.
Organisation: R. Bailey, B. Bogacka, H. Dette (A1, C1, C2), R.-D. Hilgers.
<https://www.newton.ac.uk/event/daew07>

Klausurtagung SFB 823,
01.10.-02.10.2015, Mercure Hotel, Lüdenscheid.
Organisation: W. Krämer, M. Große, Th. Ziebach (alle Z).

12th German Probability and Stochastic Days 2016 (Bochumer Stochastiktage),
01.-04.03.2016, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik.
Organisation: H. Dehling (C3)
<http://www.gpsd-2016.de/>

Diskussionspapiere

- 12/15 A. Bücher (A7), P. Kinsvater (B6) und I. Kojadinovic: Detecting breaks in the dependence of multivariate extreme-value distributions.
- 11/15 M. A. Andor, M. Frondel (beide A3) und C. Vance: Mitigating hypothetical bias: Evidence on the effects of correctives from a large field study.
- 10/15 C. Gerstenberger (C3) und D. Vogel: On the efficiency of Gini's mean difference.
- 09/15 D. Wied (A1), G. N. F. Weiß (A7) und D. Ziggel: Evaluating value-at-risk forecasts: A new set of multivariate backtests.
- 08/15: H. Dette (A1, C1), W. Wu und Z. Zhou: Change point analysis of second order characteristics in non-stationary time series.
- 07/15 Ch. Bredemeyer (A4), F. Juessen und R. Winkler: Man-cessions, fiscal policy, and the gender composition of employment.
- 06/15 T. Liboschik (C3), K. Fokianos und R. Fried (C3): tscount: An R package for analysis of count time series following generalized linear models.
- 05/15 A. Schnurr (C5) und H. Dehling (C3): Testing for structural breaks via ordinal pattern dependence.
- 04/15 S. Hermann, K. Ickstadt und Ch. H. Müller (alle B5): Prediction of crack growth based on a hierarchical diffusion model.
- 03/15 L. Linnemann (A4) und R. Winkler: Estimating nonlinear effects of fiscal policy using quantile regression methods.

- 02/15 M. Frondel, S. Sommer und C. Vance (alle A3): The burden of Germany's energy transition: An empirical analysis of distributional effects.
- 01/15 H. Dette (C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Optimal designs in regression with correlated errors.
- 41/14 A. Bücher (A7), M. Hoffmann (A1), M. Vetter und H. Dette (A1, C1): Nonparametric tests for detecting breaks in the jump behaviour of a time-continuous process
- 40/14 H. Dette (C2), V. B. Melas und R. Guchenko: Bayesian T-optimal discriminating designs.
- 39/14 B. Funke (C5) und R. Kawka: Nonparametric density estimation for multivariate bounded data using two non-negative multiplicative bias correction methods.
- 38/14 B. Berghaus (A1), A. Bücher (A7) und S. Volgushev (A1): Weak convergence of the empirical copula process with respect to weighted metrics.
- 37/14 T. J. Vogelsang und M. Wagner (A3, A4): An integrated modified OLS RESET test for cointegrating regressions.
- 36/14 H. Dette, K. Kettelhake (beide C2) und F. Bretz: Designing dose finding studies with an active control for exponential families.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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