

SFB
823

Statistik nichtlinearer dynamischer Prozesse

Ausgabe 12

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,

zu meiner großen Freude haben es überraschend viele zu unserer Klausurtagung nach Lüdenscheid geschafft. Ich möchte mich bei allen bedanken, die dieses Ereignis zu einem so großen Erfolg gemacht haben. Zumindest bin ich selbst mit diesem Gefühl nach Hause gefahren. Das lag einmal an der Qualität der Vorträge und am Engagement der Vortragenden, aber was noch viel wichtiger ist: Das, was einen SFB ausmacht, nämlich das projektübergreifende Zusammenwirken, der SFB-typische Mehrwert sozusagen, ist für alle sichtbar deutlich geworden, so dass ich mir für die nächste Begehung eigentlich keine Sorgen machen muss.



Tagungsort der diesjährigen SFB 823 - Klausurtagung: Mercure Hotel in Lüdenscheid

Was mir ebenfalls große Freude macht, ist die riesenlange Liste in diesem Infobrief von Auftritten von SFB-Mitgliedern außerhalb des SFBs, sei es auf Konferenzen, Fakultätsseminaren oder sonstigen Anlässen aller Art. Ich darf doch wohl davon ausgehen, dass dann auch alle auf ihren Eröffnungsfolien deutlich machen, woher das Geld für diese Reisen kommt? Jedenfalls kann uns niemand vorwerfen, dass wir unser Licht unter den Scheffel stellen. Machen Sie bitte weiter so!

Ihr SFB-Sprecher

Walter Krämer

Rufe, Ehrungen und Preise

Tobias Kley (C1) hat per 01.07.2015 ein Angebot als Research Officer am Institut für Statistik der London School of Economics and Political Science angenommen.

Walter Krämer (A1, Z) wurde per 01.04.2017 zum Sekretar der Klasse Ingenieur- und Wirtschaftswissenschaften der Nordrhein-Westfälischen Akademie der Wissenschaften und der Künste gewählt.

Alexander Schnurr (C5) hat einen Ruf an die Universität Marburg erhalten und einen weiteren Ruf auf eine W2-Professur für Stochastik an die Universität Siegen zum 01.09.2015 angenommen.

Stanislav Volgushev (A1) hat per 01.08.2015 ein Angebot als Assistant Professor am Department of Statistical Sciences in Cornell angenommen.

Allen Berufenen und Geehrten einen herzlichen Glückwunsch!

Veröffentlichungen

1) Publikationen in Fachzeitschriften

zur Veröffentlichung angenommen:

D. Belomestny (C5) und T. Nagapetyan: Multilevel path simulation for weak approximation schemes with application to Lévy-driven SDEs, erscheint in: *Bernoulli*.

B. Berghaus, A. Bücher (beide A7) und S. Volgushev (A1): Weak convergence of the empirical copula process with respect to weighted metrics, erscheint in: *Bernoulli*.

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

A. Bücher (A7) and I. Kojadinovic: Dependent multiplier bootstraps for non-degenerate U-statistics under mixing conditions with applications, erscheint in: *Journal of Statistical Planning and Inference*.

S.-K. Chao, K. Proksch (C4), H. Dette (A1, C1) und W. Härdle: Confidence corridors for multivariate generalized quantile regression, erscheint in: *Journal of Business & Economic Statistics*.

H. Dette (C1, C2), K. Kettelhake und F. Bretz: Designing dose finding studies with an active control for exponential families, erscheint in: *Biometrika*.

H. Dette und M. Konstantinou (beide C2): Locally optimal designs for errors-in-variables models, erscheint in: *Biometrika*.

H. Dette (A1, C1), N. Neumeyer und S. Hoderlein: Testing multivariate economic restrictions using quantiles: The example of Slutsky negative semidefiniteness, erscheint in: *Journal of Econometrics*.

H. Dette (C1, C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Optimal designs in regression with correlated errors, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Dette und K. Schorning (beide A1, C1, C2): Optimal designs for comparing curves, erscheint in: *Annals of Statistics*.

H. Dette (C1, C2), S. Titoff, S. Volgushev (A1) und F. Bretz: Dose response signal detection under model uncertainty, erscheint in: *Biometrics*.

A. Dürre (C3) und D. Vogel: Asymptotics of the two-stage spatial sign correlation, erscheint in: *Journal of Multivariate Analysis*.

S. Fischer und A. Schumann (beide B6): Robust flood statistics - comparison of Peak over Threshold approaches based on monthly maxima and TL-moments, erscheint in: *Hydrological Sciences Journal*.

M. Frondel, C. M. Schmidt und C. Vance (alle A3): Asymmetry: Resurrecting the Roots, erscheint in: *Quarterly Review of Economics and Finance*.

M. Frondel und C. Vance (beide A3): Time Lags in the Pass-Through of Crude-Oil Prices: Big Data Evidence from the German Gasoline Market, erscheint in: *Applied Economics Letters*.

S. Kuhnt und A. Rehage (beide B1): An angle-based multivariate functional pseudo-depth for shape outlier detection, erscheint in: *Journal of Multivariate Analysis*.

Ch. H. Müller, S. Szugat (beide B5), N. Celik und B. R. Clarke: Influence functions of trimmed likelihood estimators for lifetime experiments, erscheint in: *Statistics*.

N. Rudak, B. Hussong und S. Kuhnt (alle B1): Simultaneous optimization of multiple correlated responses with application to a thermal spraying process, erscheint in: *Quality and Reliability Engineering International*.

N. Rudak, S. Kuhnt (beide B1) und E. Riccomagno: Numerical algebraic fan of a design for statistical model building, erscheint in: *Statistica Sinica*.

T. A. Schmitt, R. Schäfer, H. Dette (A1, C1) und T. Guhr: Quantile correlations: Uncovering temporal dependencies in financial time series, erscheint in: *International Journal of Theoretical and Applied Finance*.

M. Schulte und A. Schumann (beide B6): Statistische Bewertung der Hochwasserkoinzidenz zur Planung des technischen Rückhalts, erscheint in: *Wasserwirtschaft*.

S. Sengupta, S. Volgushev (A1) und X. Shao: A subsampled double bootstrap for massive data, erscheint in: *Journal of the American Statistical Association*.

W. Tillmann (B1, B4), D. Biermann (B4), C. Weihs (B3, B4, C2), M. Ferreira, M. Kansteiner und S. Herbrandt (alle B4): Statistical evaluations of machining parameters and forces during the grinding process of single grain diamonds and metal matrix composites on mineral subsoil, erscheint in: *Diamond and related Materials*.

Seit dem letzten Infobrief erschienen:

- M. Andor, M. Frondel (beide A3) und S. Sommer: Reform des EU-Emissionshandels: Eine Alternative zu Mindestpreisen für Zertifikate und der Marktstabilitätsreserve, *Zeitschrift für Wirtschaftspolitik* 64 (2), 171-188 (2015).
- B. Augurzky, A. R. Reichert und H. Tauchmann (A3): Self-perceived Job Insecurity and the Demand for Medical Rehabilitation: Does Fear of Unemployment Reduce Health Care Utilization?, *Health Economics* 24 (1), 8-25 (2015).
- D. Belomestny und V. Panov (beide C5): Statistical inference for generalized Ornstein-Uhlenbeck processes, *Electronic Journal of Statistics* 9 (20), 1974-2006 (2015).
- T. Berens, G. Weiß (A7) und D. Wied (A1): Testing for Structural Breaks in Correlations: Does it Improve Value-at-Risk Forecasting?, *Journal of Empirical Finance* 35, 135-152 (2015).
- M. Borowski (B1), D. Busse und R. Fried (C3): Robust Online-Surveillance of Trend-coherence in Multivariate Data Streams, *Statistics and Computing* 25, 913-928 (2015).
- C. Bünnings und H. Tauchmann (A3): Who Opt's out of the Statutory Health Insurance? A Discrete Time Hazard Model for Germany, *Health Economics* 24 (10), 1331-1347 (2015).
- H. Dehling (C1, C3), O. S. Sharipov und M. Wendler (C1,C3): Bootstrap for dependent Hilbert space valued random variables with applications to von Mises statistics, *Journal of Multivariate Analysis* 133, 200-215 (2015).
- H. Dette (A1, C1, C2), V. B. Melas und R. Guchenko: T -optimal discriminating designs, *Annals of Statistics* 43 (5), 1959-1985 (2015).
- S. Fischer, R. Fried und A. Schumann (alle B6): Examination for robustness of parametric estimators for flood statistics in the context of extraordinary extreme events, *Hydrology and Earth Systems Sciences Discussions* 19, 1-24 (2015).
- S. Fischer und A. Schumann (beide B6): Statistische Probleme bei der Schätzung von Abflussspendendiagrammen, *Hydrologie und Wasserwirtschaft* 59, Heft 4 (2015).
- M. Frondel (A3), S. Sommer und C. Vance (A3): The Burden of Germany's Energy Transition: An Empirical Analysis of Distributional Effects, *Economic Analysis and Policy* 45, 89-99 (2015).
- S. Gergen, A. Nagathil und R. Martin (beide B3): Classification of reverberant audio signals using clustered ad-hoc distributed microphones, *Signal Processing* 107, 21-32 (2015).
- F. Irresberger (A7), J. Mühlnickel und G. Weiß (A7): Explaining Bank Stock Performance with Crisis Sentiment, *Journal of Banking & Finance* 59, 311-329, (2015).

M. Kansteiner, M. Kipp, S. Herbrandt, M. P. Ferreira und D. Biermann (alle B4): Process Forces and Groove Development in Single Grain Scratch Tests of Concrete and Reinforced Concrete, *Applied Mechanics and Materials* 794, 207-215 (2015).

W. Krämer (A1) und D. Wied (beide A1): A Simple and Focused Backtest of Value at Risk, *Economics Letters*, doi:10.1016/j.econlet.2015.10.028.

M. Schulte und A. Schumann (beide B6): Extensive spatio-temporal assessment of flood events by application of pair-copulas, *Proceedings of the International Association of Hydrological Sciences (PIAHS)* 370, 177-181 (2015).

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

N. Bauer (C2), K. Friedrichs (B3), B. Bischl (C2) und C. Weihs (C2, B3, B4): Fast Model Based Optimization of Tone Onset Detection by Instance Sampling, in: A. Wilhelm, H. A. Adalbert (Hrsg.): *Analysis of Large and Complex Data*, Springer International Publishing, 2015.

H. Dette (A1, C1, C2), A. Pepelyshev und A. Zhigljavsky: Design for linear regression models with correlated errors, in: *Handbook of Design and Analysis of Experiments*, Chapman & Hall, Boca Raton, 237-276 (2015).

D. Horn (C2), T. Wagner, D. Biermann, C. Weihs (C2) und B. Bischl (C2): Model-based multi-objective optimization: Taxonomy, multi-point proposal, toolbox and benchmark, in: A. Gaspar-Cunha, C. Henggeler Antunes, C. C. Coello (Hrsg.): *Evolutionary Multi-Criterion Optimization (EMO)*, volume 9018 of *Lecture Notes in Computer Science*, Springer, 2015, 64-78.

W. Krämer (A1), P. M. Lynen, C. Kiefer und W. Hogrebe: *Unschärfe*, herausgegeben von der Nordrhein-Westfälischen Akademie der Wissenschaften, F. Schöningh Verlag, Paderborn (2015).

W. Krämer (A1) und F. -X. Kaufmann (Hrsg.): *Die demografische Zeitbombe. Fakten und Folgen des Geburtendefizits*, F. Schöningh Verlag, Paderborn (2015).

W. Krämer (A1): *So lügt man mit Statistik*, Aktualisierte Neuauflage, Campus Verlag, Frankfurt (2015).

W. Krämer (A1): *Statistik für alle - Die 101 wichtigsten Begriffe anschaulich erklärt*, Springer Spektrum, Berlin (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, in: *Proceedings Jahrestagung der Deutschen Gesellschaft für Audiologie (DGA)*, Bochum, ISBN 978-3-9813141-5-1 (2015) (auch: Vortrag/Poster).

D. Vogel und R. Fried (C3): Robust Change Detection in the Dependence Structure of Multivariate Time Series, in: K. Nordhausen und S. Taskinen (Hrsg.): *Modern Nonparametric, Robust and Multivariate Methods*, Festschrift in Honour of Hannu Oja, 2015, 265-288.

3) Populärwissenschaftliche Texte

M. Frondel (A3): Franziskus' Umwelt-Enzyklika: Eine Utopie! *WiSt Wirtschaftswissenschaftliches Studium Zeitschrift für Studium und Forschung* 44 (9), 481 (2015).

W. Krämer (A1): Ein Volk von Panikmachern, *Forschung & Lehre*, 09/15.

4) Medienbeiträge

W. Krämer (A1): Deflation ist noch weit weg, *Focus*, 05/2015.

W. Krämer (A1): Zu Tisch im Garten des Vermessers, Interview in der *taz*, 23.08.2015.

W. Krämer (A1): Dem Willkommensrausch folgt der Kater, *F.A.Z.*, 21.09.2015.

W. Krämer (A1): Verbietet endlich das Altern, *WirtschaftsWoche*, 30.10.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Für Athen heißt es: Take it or leave it, Interview in *Rheinische Post*, 27.07.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Kein europäisches Schatzamt!, Gastbeitrag in der *FAZ*, 28.07.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Wir berühren massiv politische und ideologische Interessen, Interview in *WirtschaftsWoche*, 25.09.2015.

Vorträge

1) Eingeladene Haupt- und Plenarvorträge

H. Dehling (C1, C3): Empirical Processes of Dependent Data, Conference in honour of Paul Doukhan, Institut Henri Poincare, Paris, Frankreich, 12.05.2015.

H. Dehling (C1, C3): New Techniques for Empirical Processes of Dependent Data, Conference in honour of Thomas Mikosch, Kopenhagen, Dänemark, 22.06.2015.

H. Dette (A1, C2, C2): Smooth backfitting in additive inverse regression, Joint Statistical Meetings (JSM 2015), Seattle, U.S.A., 08.08.-13.08.2015.

R. Fried, H. Dehling und M. Wendler (alle C3): Robust and nonparametric detection of shifts in Time Series, 9th International Statistics Congress of the Turkish Statistical Association, Antalya, Türkei, 28.10.-01.11.2015.

W. Krämer (A1): Wahrheiten suchen mit Statistik – Wie man mit Daten umgeht und wie nicht, 20. Berliner Tag der Mathematik, 09.05.2015.

W. Krämer (A1): Panikrepublik Deutschland. Warum wir uns immer die falschen Sorgen machen und wie die Medien dazu beitragen, Mitgliederversammlung Industrieverband Agrar, Berlin, 19.05.2015.

W. Krämer (A1): Lüge und Statistik, Jahrestagung Kommunaler Schadenausgleich der Länder Brandenburg, Mecklenburg-Vorpommern, Sachsen, Sachsen-Anhalt und Thüringen, Magdeburg, 17.07.2015.

W. Krämer (A1): Lebensmittelskandale - reale Bedrohung oder Panikmache, Friedrich-Naumann-Stiftung Inlandsakademie - Stipendiaten, Berlin, 30.09.2015.

Ch. H. Müller (B5): Data depth for AR(1) models with application to crack growth, Frontiers in Industrial Statistics (FIS 2015), Tianjin, China, 19.06.2015.

Ch. H. Müller (B5): Data depth for autoregression with application to crack growth, PROBASTAT 2015, 7th International Conference on Probability and Statistics, Smolenice, Slowakei, 30.06.2015.

Ch. H. Müller (B5): Data depth, European Conference on Data Analysis 2015, Colchester, Großbritannien, 02.09.2015.

K. Ickstadt (B5): Prediction for Stochastic Growth Processes in Fatigue Experiments, 4th Symposium on Games and Decisions in Reliability and Risk, Istanbul, Türkei, 18.06.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Evidenzbasierte Wirtschaftspolitik, Bundesarbeitsgemeinschaft Wirtschaft und Finanzen (Bündnis 90/Die Grünen), Berlin, 21.06.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Die Energiewende europäisch integrieren, ESYS und Euro-CASE Veranstaltung: "Energiewende und Energieunion: Wege zu einer europäisch integrierten und nachhaltigen Energiepolitik", Brüssel, Belgien, 02.07.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Die Balance von Effizienz und Solidarität als Grundbaustein der Sozialen Marktwirtschaft, Preisverleihung Roman Herzog Institut, München, 07.07.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): 11. Gesamtwirtschaftliche Entwicklung, Handelsblatt CFO Kongress, Frankfurt, 08.07.2015.

Ch. M. Schmidt (A3): Welche Zukunft hat der Euro?, Keynote im Rahmen der Verleihung Schmalenbach-Preis 2015 beim 69. Deutscher Betriebswirtschaftler-Tag, Düsseldorf, 23.09.2015.

C. Weihs (C2, B3, B4): Efficient global optimization: motivation, variation, and application, European Conference on Data Analysis (ECDA) 2015, Colchester, Großbritannien, 02.-04.09.2015.

2) Sonstige Vorträge und Podiumsauftritte auf Konferenzen

S. Abbas (C3): Control charts for biosignals based on robust two-sample tests, Statistische Woche, Hamburg, 15.-18.09.2015. (auch: Biomedizinische Technik, Lübeck, 16.-18.09.2015).

M. Andor (A3): Mitigating Hypothetical Bias: Evidence on the Effects of Correctives from a Large Field Study, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik 2015, Münster, 06.-09.09.2015.

N. Bauer (C2): Multivariate Supervised Classification for Tone Onset Detection, European Conference on Data Analysis (ECDA) 2015, Colchester, Großbritannien, 02.-04.09.2015.

D. Belomestny (C5): Low-rank diffusion covariance matrix estimation under presence of jumps, Workshop on Nonparametric and high-dimensional statistics, Heidelberg, 20.07.2015.

A. Betken (C3): Testing for change-points in long-range dependent time series by means of a self-normalized Wilcoxon test, 30th European Meeting of Statisticians 2015, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015.

J. Buchsteiner (C1): The sequential empirical process under long-range dependence, 30th European Meeting of Statisticians 2015, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015.

A. Bücher (A7): On the block maxima method in multivariate extremes, European Meeting of Statisticians, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015.

A. Bücher (A7): Extreme-value copula estimation based on block maxima of a multivariate stationary time series, Workshop: Recent developments in statistics for complex dependent data, Loccum, Deutschland, 27.-30.08.2015.

H. Dehling (C1, C3): New Techniques for Empirical Processes of Dependent Data, 43rd Annual Meeting of the Statistical Society of Canada, Halifax, Nova Scotia, 16.06.2015 (auch: 38th Conference on Stochastic Processes and their Applications, Oxford, Großbritannien, 16.07.2015).

H. Dehling (C1, C3): Robust Tests for Structural Breaks in Long Range Dependent Time Series, 30th European Meeting of Statisticians 2015, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015.

H. Dehling (C1, C3): Testing for Structural Breaks via Ordinal Pattern Dependence, Workshop on Recent Developments in Statistics for Complex Dependent Data, Loccum, 30.08.2015. (auch: Conference in Honor of Paul Doukhan, Institut Henri Poincare, Paris, Frankreich, 11.-13.05.2015).

H. Dehling (C1, C3): Robust Change-Point Tests for Time Series, Workshop on Mathematical Foundations of Heavy-Tailed Analysis, Kopenhagen, Dänemark, 26.06.2015.

H. Dette (A1 C1, C2): Copula-based spectral analysis, Workshop "Copulae: On the crossroads of mathematics and economics", Oberwolfach, 13.04.2015.

H. Dette (A1, C1, C2): Quantile-based spectral analysis, SFB 649 "Economic Risk" Conference, Motzen, 18.07.2015.

A. Dürre (C3): Robust break point detection in panel data, Workshop: Recent developments in statistics for complex dependent data, Loccum, 27.-30.08.2015.

A. Dürre (C3): A test for change in the auto(-rank-)correlation of time series, 21. DStatG Nachwuchsworkshop, Hamburg, 14.-15.09.2015.

A. Dürre (C3): A test for change in rank-correlation of multivariate time series, Statistische Woche, Hamburg, 15.-18.09.2015.

F. Dunker (C4): Nonparametric Identification of Endogenous and Heterogeneous Discrete Choice Models, Universität Konstanz, 04.05.2015.

F. Dunker (C4): On parameter identification in stochastic differential equations by penalized maximum likelihood, Conference on Applied Inverse Problems, Helsinki, Finland, 29.05.2015.

S. Fischer (B6): Multivariate Generalized Linear Statistics for Dependent Data, European Meeting of Statisticians, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015.

R. Fried (C3): Robust and nonparametric detection of shifts using two-sample U-statistics and U-quantiles, Workshop: Recent developments in statistics for complex dependent data, Loccum, 27.-30.08.2015.

R. Fried (C3): Robust and nonparametric detection of shifts using two-sample U-statistics and U-quantiles, 2nd workshop on goodness-of-fit and change-point problems, Athen, Griechenland, 04.-06.09.2015.

M. Frondel (A3): From Fuel Taxation to Efficiency Standards: A Wrong Turn in European Climate Protection?, Jahrestagung des Vereins für Socialpolitik 2015, Münster, 06.-09.09.2015.

C. Gerstenberger (C3): A Wilcoxon-Based Testing Procedure for Distinguishing between Long-Range Dependence and Short-Range Dependence with a Change in Mean, 30th European Meeting of Statisticians 2015, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015 (auch: Statistische Woche, Hamburg, 15.-18.09.2015).

S. Hermann (B5): Prediction of crack growth based on a hierarchical diffusion model, 14th Workshop on Quality Improvement Methods, Dortmund, 06.06.2015.

S. Hermann (B5): Modeling crack growth in fatigue experiments, 9th Workshop on Bayesian Inference in Stochastic Processes (BISB 9), Istanbul, Türkei, 16.06.2015.

S. Hermann (B5): Modeling crack growth in fatigue experiments - A Bayesian prediction approach based on a nonhomogeneous Poisson process, 11. Doktorandentreffen Stochastik 2015, Berlin, 05.08.2015.

B. Hussong (B1): Investigation of the interface of overlapping splats for a WC-based Cermet, International Thermal Spraying Conference, Long Beach, California, USA, 11.-14.05.2015.

F. Irresberger (A7): Depositor Sentiment, NFA 2015 Conference, Lake Louise, Kanada, 18.09.2015 (auch: Finance Center Münster, WWU Münster, 02.07.2015 und Terry College of Business, University of Georgia, Athens, U.S.A., 05.10.2015).

M. Kansteiner (B4): Process Forces and Groove Development in Single Grain Scratch Tests of Concrete and Reinforced Concrete, 5.WGP-Jahreskongress Hamburg, 07.-08.09.2015.

M. Konstantinou (C2): Locally optimal designs for errors-in-variables models, Conference on Design of Experiments in Drug development, Isaac Newton Institute, Cambridge, Großbritannien, 08.07.2015.

S. Kuhnt (B1): Functional generalized linear models and outlier detection for an HVOF spraying process, ENBIS-15, Prag, Tschechien, 06.-10.09.2015.

- S. Kuhnt (B1): Methods from algebraic statistics to determine identifiable regression models from noisy designs, Statistische Woche 2015, Hamburg, 15.-18.09.2015.
- Ch. P. Kustoscz (B5): Depth Based Estimation and Testing for Explosive Autoregressive Processes with Applications, 11. Doktorandentreffen Stochastik 2015, Berlin, 07.08.2015.
- T. Liboschik (C3): Monitoring of count time series following generalized linear models, Statistische Woche, Hamburg, 15.-18.09.2015.
- U. Ligges (B4): Model Based Optimization of a Statistical Simulation Model for Single Diamond Grinding, Statistical Computing 2015, Schloss Reinsburg, Günzburg, 19.-22.07.2015.
- S. Gergen (B3): Reduction of reverberation effects in the MFCC modulation spectrum for improved classification of acoustic signals, Interspeech 2015, Dresden, 06.-10.09.2015.
- S. H. Meinke (B5): Modeling of crack propagation in different steel specimens with stochastic differential equations by using trimmed likelihoods, Statistische Woche, Hamburg, 18.09.2015.
- K. Proksch (C4): Simultaneous confidence bands in nonparametric inverse and direct regression, Conference on Applied Inverse Problems, Helsinki, Finland, 29.05.2015.
- K. Proksch (C4): Confidence regions for images observed under the Radon transform, Statistische Woche 2015, Hamburg, 15.09.2015.
- A. Rehage (B1): Functional outlier detection using data depth in a thermal spraying process, Statistische Woche 2015, Hamburg, 15.-18.09.2015.
- N. Rudak (B1): On- and offline detection of structural breaks in thermal spraying processes, ENBIS-15, Prag, Tschechien, 06.-10.09.2015.
- Ch. M. Schmidt (A3): Ungleichheit in Deutschland, ARGE-Podiumsdiskussion, Münster, 09.09.2015.
- Ch. M. Schmidt (A3): Wachstum, Wohlstand, Lebensqualität - Paradigmenwechsel oder Chimäre?, Bertelsmann-Stiftung - Diskussion mit der Stiglitz-Kommission II, Berlin, 16.09.2015.
- A. Schnurr (C5): Fine properties of paths of homogeneous diffusions with jumps, 38th Conference on Stochastic Processes and their Applications, Oxford, Großbritannien, 13.-17.07.2015.
- A. Schnurr (C5): Ordinale-Muster-Statistik mit Anwendungen in Finanz, Hydrologie und Medizin, Workshop über aktuelle Probleme in der Wahrscheinlichkeitstheorie, Siegen, 03.07.2015.
- A. Schnurr (C5): Detecting Structural Breaks via Ordinal Pattern Dependence, DynStoch-Meeting, Lund, Schweden, 27.-29.05.2015.

A. Schumann (B6): Extensive Spatial-Temporal Assessment of flood events by Application of Pair-Copulas, 26th IUGG General Assembly 2015, Prag, Tschechische Republik, 22.06.-02.07.2015.

S. Szugat (B5): Using data depth to find prediction intervals for state dependent point processes with application to fatigue experiments, Statistische Woche, Hamburg, 18.09.2015.

J. Tewes (C1): Weighted tests for distributional change in long-memory processes, 30th European Meeting of Statisticians 2015, Amsterdam, Niederlande, 06.-10.07.2015.

W. Tillmann (B4): Influence of the diamond size and diamond distribution on the wear behavior of sintered diamond-metal composites during the machining of reinforced concrete - Investigations by computer tomography and statistical evaluations, EuroPM2015, Reims, Frankreich, 04.-07.10.2015.

D. Wied (A1): Testing for Relevant Differences in Time Series Models, 8th International Workshop on Simulation, Wien, Österreich, 21.-25.09.2015.

J. Woerner (C5): Oscillating Ornstein-Uhlenbeck processes: capturing seasonalities in electricity markets, 38th Conference on Stochastic Processes and their Applications, Oxford, Großbritannien, 13.-17.07.2015.

J. Woerner (C5): Statistical inference for fractional Lévy processes, DynStoch-Meeting, Lund, Schweden, 27.-29.05.2015.

3) Vorträge in Fakultätsseminaren

H. Dehling (C1, C3): New Techniques for Empirical Processes of Dependent Data, Department of Mathematics and Statistics, University of Ottawa, Kanada, 22.05.2015.

H. Dehling (C1, C3): Dependent Processes in Probability Theory, Statistics and Analysis, Mathematics and Statistics Seminar, Acadia University, Wolfville, Nova Scotia, Kanada, 11.06.2015.

M. Frondel (A3): Demand Response to Power Prices: Evidence from German Households, Forschungsseminar Universität Siegen, Juli 2015.

S. Hermann (B5): Prediction of crack growth based on a hierarchical diffusion model, Laboratoire Jean Kuntzmann, Grenoble, Frankreich, 18.06.2015.

W. Krämer (A1): Die Ökonomie von Panik, Angst und Risiko, Ökonomisches Kolloquium am IAAEU, Universität Trier, 29.06.2015.

W. Krämer (A1): Partial orderings of default predictions, Economic Risk Seminar, Humboldt-Universität Berlin, 06.07.2015.

W. Krämer (A1): Warum dick nicht doof macht und Genmais nicht tötet – Über Risiken und Nebenwirkungen der Unstatistik, ZBW – Leibniz-Informationszentrum Wirtschaft, 19.09.2015.

- D. Kobe (C5): Modeling electricity spot prices by Oscillating Ornstein-Uhlenbeck processes, Oberseminar Mathematische Statistik, Universität Augsburg, 28.9.2015.
- R. Maurer (B5): DIN EN 1992-2: Hintergrund zu einigen brückenspezifischen Regelungen, Weiterbildung für Tragwerksplaner 2015, Seminar 5 - Brückenbau, Darmstadt, September 2015.
- R. Maurer (B5): Nachrechnung und Ertüchtigung von Betonbrücken. Weiterbildung für Tragwerksplaner 2015, Seminar 5 - Brückenbau, Darmstadt, September 2015.
- R. Maurer (B5): Nachrechnung und Ertüchtigung von Betonbrücken, VSVI-Seminar Nr. 16-2014/2015, Koblenz, September 2015.
- A. Schnurr (C5): Stetige negativ definite Funktionen und stochastische Prozesse, Oberseminar Analysis und Stochastik, Kaiserslautern, 16.06.2015.
- D. Wied (A1): Testing for Constant Dependence Structure of Asset Returns, Frankfurt School of Finance & Management, 18.05.2015.
- D. Wied (A1): Lohnverteilungen mit Mindestlohn: Distributional Regression und Spezifikationstests, LMU München, 07.07.2015.
- J. Woerner (C5): Continuous-time moving average processes: Theory & Applications, Stochastisches Kolloquium, Universität Brest, Frankreich, 11.06.2015.

4) Software

- A. Rehage und S. Kuhnt (beide B1): alphaOutlier: Obtain Alpha-Outlier Regions for Well-Known Probability Distributions. R package version 1.0.0 (2015).
- A. Dürre (C3) und D. Vogel: sscor: Robust Correlation Estimation and Testing Based on Spatial Signs. R package version 0.1 (2015).

Abschlussarbeiten (Master/Diplom)

- L. Altenschulte (A7): Ausfallrisiken von Versicherungsunternehmen, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 18.06.2015.
- M. Becke (B4): Computertomographie- und lichtmikroskopiegestützte Analyse der Verschleißmechanismen von Diamantwerkzeugen bei der Bearbeitung von Stahlbeton, TU Dortmund, Fakultät Maschinenbau, September 2015.
- F. Deiters (B6): Untersuchung des Einflusses einer saisonal differenzierten hochwasserstatistischen Analyse auf die Berechnung extremer Quantile am Beispiel ausgewählter Pegel in Sachsen, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 15.05.2015.
- Y. Düring und C. Feise (B4): Untersuchung des Kernbohrprozesses mit diamant-impregnierten Einzelsegmenten von hochhartem Beton und Stahlbeton, TU Dortmund, Fakultät Maschinenbau, September 2015.
- J. Gabrysch (A7): Extreme Liquidity Risk and the Pricing of Credit Default Swaps, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 17.08.2015.

S. Gabrysch (A7): Extreme Co-Sentiment and the Pricing of Credit Default Swaps, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 17.08.2015.

F. Irresberger (A1): Schätzrisiken bei Value-at-Risk und Expected Shortfall Backtests, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 15.09.2015.

C. Jungmann (A7): Pricing und Hedging von Variable Annuities mit Guaranteed Minimum Accumulation Benefits unter unterschiedlichem Kundenverhalten, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 27.08.2015.

J. Mielke (C3): Entwicklung und Evaluierung von robusten, MOSUM-artigen Teststatistiken für Strukturbruchtests auf Lageänderung unter Unabhängigkeit, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 15.05.2015.

A. Pessik (C5): Schätzen und Konfidenzintervalle für den Hurst-Parameter einer fraktionalen Brownschen Bewegung, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 14.09.2015

C. Priesmeier (B4): Untersuchung des Schleifprozesses mineralisch-metallischer Verbundwerkstoffe mit metallisch gebundenen Diamantwerkzeugen, TU Dortmund, Fakultät Maschinenbau, April 2015.

K. Quintus (A7): Bailout Sentiment, TU Dortmund, Fakultät WiSo, 31.07.2015.

S. Schmidt (C5): Some aspects of fractional Lévy processes, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 20.09.2015.

L. Sivalingam (B4): Untersuchung des Diamantkernbohrprozesses mit diamant-impregnierten metallisch gebundenen Schleifsegmenten mit unterschiedlicher Korngröße und Konzentration an hochhartem Beton, TU Dortmund, Fakultät Maschinenbau, September 2015.

B. Sischka (A1): Modifikation eines Detektors zur Überwachung von Stationarität und Kointegrationsbeziehungen durch Verwendung rekursiver Residuen, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 13.08.2015.

M. Swora (B5): Vereinfachte Simplex-Datentiefe in Regressionsmodellen, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 11.06.2015.

F. Wolff (B5): Vergleich verschiedener nichtlinearer Modelle für die Prognose von Risswachstum, TU Dortmund, Fakultät Statistik, 06.05.2015.

Promotionen

B. Berghaus (A7): The Empirical Copula Process: Weak Convergence and Applications to Time Series, Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 03.07.2015.

S. Glaser (C5): Limit theorems of the power variation of fractional Lévy processes, TU Dortmund, Fakultät für Mathematik, 15.09.2015.

F. Irresberger (A7): Essays on Stock Performance, Regulation, and Financial Stability of Banks and Insurers, WiSo Fakultät, TU Dortmund, 31.08.2015.

S. Jäschke (A1), On modeling financial risk with tail copulas, Fakultät Statistik, TU Dortmund, 14.07.2015.

Sonstiges

A. Bücher (A7) vertritt im Wintersemester 2015/2016 eine Professur für Mathematische Statistik und industrielle Anwendungen an der TU Dortmund.

H. Dehling (C1, C3) wurde im Juni 2015 zum Sprecher der Konferenz Mathematischer Fachbereiche gewählt.

R. Fried (C3) organisiert eine Sektion über Time Series Modelling and Computation bei der 8. International Conference of the ERCIM WG on Computational and Methodological Statistics (CMStatistics 2015), London, U.K., 12.-14.12.2015.

W. Krämer (A1) organisiert und leitet zusammen mit der Deutschen Statistischen Gesellschaft das 24. Wissenschaftliche Kolloquium "Statistik verstehen – Orientierung in der Informationsgesellschaft" am Statistischen Bundesamt Wiesbaden, 19.-20.11.2015.

Ch. H. Müller (B5) ist Mitglied des wissenschaftlichen Programmkomitees der Statistischen Woche 2015, Hamburg, 15.-18.09.2015.

Ch. H. Müller (B5) ist Vorsitzende des Programmkomitees der DAGStat Tagung 2016 (4th Joint Statistical Meeting of the Deutsche Arbeitsgemeinschaft Statistik "Statistics under one umbrella"), Göttingen, 14.-18.03.2016.

G. Weiß (A7) vertritt im Wintersemester 2015/2016 eine Professur für Betriebswirtschaftslehre / Nachhaltige Finanzdienstleistungen, insb. Banken an der Universität Leipzig.

D. Wied (A1) vertritt im Wintersemester 2015/2016 eine W3-Professur für Statistik und Ökonometrie an der Universität zu Köln.

SFB-Mitglieder unterwegs

H. Dehling (C1, C3) war vom 14.05. bis 18.06.2015 als Harrison McCain Visiting Professor zu einem Forschungsaufenthalt an der Acadia University, Wolfville, Nova Scotia, Kanada.

S. Hermann (B5) war vom 17.06.-19.06.2015 zu Gast bei A. Leclercq Samson (Laboratoire Jean Kuntzmann, Département de Statistique, Grenoble) zur gemeinsamen Forschung über "Particle filtering for hierarchical stochastic differential equation models".

S. Hermann (B5) war vom 21.09. bis 25.09.2015 zu Gast bei F. Ruggeri (CNR IMATI, Istituto di Matematica Applicata e Tecnologie Informatiche, Mailand) zur Fortführung der gemeinsamen Forschung an "Modelling wear degradation in cylinder liners".

J. Woerner (C5) war vom 07.06. bis 12.06.2015. zu Gast bei Prof. Brice Franke an der Universität Brest (Frankreich) zur Fortführung der Forschung an statistischen Methoden für fraktionale Diffusionen.

Gastwissenschaftler

Fumiya Akashi (Waseda University, Tokyo, Japan): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 12.09.2015-29.10.2015.

Rosemary Bailey (School of Mathematics and Statistics, University of St. Andrews, Scotland): Vortrag "Designs for variety trials with very low replication", 03.06.-13.06.2015.

Jozef Baruník (Institute of Economic Studies, Charles University, Prague, Czech Republic): Vortrag "Disentangling the sources of connectedness between economic variables", 24.05.-27.05.2015.

Taras Bodnar (Institut für Mathematik, Humboldt-Universität zu Berlin): Forschungsaufenthalt an der Fakultät für Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 24.06.-25.06.2015.

Justin Chown (Institut de Statistique, Biostatistique et Sciences Actuarielles, Université catholique de Louvain, Belgium): Vortrag "Some nonparametric approaches for analyzing regressions with incomplete data", 18.08.-19.08.2015.

Matthias Eckardt (Department of Computer Science, Humboldt-Universität zu Berlin): Vortrag "Quantile dependence graph for multivariate time series", 01.06.2015.

Thorsten Hohage (Institut für Numerische und Angewandte Mathematik, Georg-August-Universität Göttingen): Vortrag "Variational regularization of statistical inverse problems", 15.05.2015.

Thomas Hotz (Institut für Mathematik, Fakultät für Mathematik und Naturwissenschaften, Technische Universität Ilmenau): Vortrag "Universal, non-asymptotic confidence sets for circular means", 18.06.-19.06.2015.

Marie Hušková (Department of Statistics, Faculty of Mathematics and Physics, Charles University in Prague, Czech Republic): Vortrag "Some results in change point analysis", 15.06.-17.06.2015.

Stefanos Kechagias (Department of Statistics and Operations Research, University of North Carolina at Chapel Hill, USA): Vortrag "Bivariate long-range dependent time series models with general phase", 29.06.-03.07.2015.

Jihyun Kim (Toulouse School of Economics, France): Vortrag "Mean Reversion and Stationarity: A New Perspective from Diffusion Models", 19.10.-23.10.2015.

Hannes Leeb (Department of Statistics and Operations Research, University of Vienna, Austria): Vortrag "On conditional moments of high-dimensional random vectors given lower-dimensional projections", 05.05.-06.05.2015.

Yan Liu (Waseda University, Tokyo, Japan): Forschungsaufenthalt an der Fakultät Mathematik, Ruhr-Universität Bochum, 12.09.2015-29.10.2015.

Daniel Peña (Faculty of Law and Social Sciences, Universidad Carlos III de Madrid, Spain): Vortrag "Generalized Dynamic Principal Components", 27.10.-29.10.2015.

Fabrizio Ruggeri (Consiglio Nazionale delle Ricerche, Istituto di Matematica Applicata e Tecnologie Informatiche, Milano, Italy): Vortrag "On Bayesian estimation of thermal diffusivity in materials", 18.05.-22.05.2015.

Gernot Müller und Armin Seibert (Institut für Mathematik, Universität Augsburg): Vortrag "Bayesian inference of a stable CARMA model for electricity spot price dynamics", 16.06.-18.06.2015.

Venkatraman E. Seshan (Epidemiology & Biostatistics, Memorial Sloan Kettering Cancer Center, New York, USA): Vortrag "Circular Binary Segmentation: Theory and Applications in Cancer Genomics", 10.05.-13.05.2015.

Daniel Vogel (Institute for Complex Systems and Mathematical Biology, University of Aberdeen, U.K.): Vortrag: "Efficiency and Robustness Properties of Gini's mean difference", 11.05.-25.06.2015.

Workshops, Tagungen

Bereits gewesen:

5th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series,
11.06.-12.06.2015, Ruhr-Universität Bochum.

Organisation: A. Bücher (A7), H. Dette (A1, C1, C2), M. Hallin, T. Kley und S. Volgushev.

<http://www.ruhr-uni-bochum.de/mathematik3/en/research/sfb/workshop2015.html>

Design and Analysis of Experiments in Healthcare,

06.07.-10.07.2015, Isaac Newton Institute for Mathematical Sciences, Cambridge, Großbritannien.

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 (A1, Z).

14th Workshop on Quality Improvement Methods,

05.06.-06.06.2015, Hotel Esplanade Dortmund.

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

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



Zehn Vortragende aus fünf Ländern haben zu folgenden Themen referiert: Versuchsplanung, Kontrollkarten und Unsicherheiten im Produktionsprozess, statistische Analyse von Ausfällen technischer Geräte, Vorhersage von Risswachstum, Schätzungen bei Diffusionsmodellen mit Sprüngen.

Kommt noch:

7th International Water Resources Management Conference of ICWRS,

18.05.-20.05.2016, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik.

Organisation: A. Schumann (B6)

<http://iahs-rub.hydrology.ruhr-uni-bochum.de/>

12th German Probability and Stochastic Days 2016 (Bochumer Stochastiktage),

01.03.-04.03.2016, Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik.

Organisation: H. Dehling (C1, C3).

<http://www.gpsd-2016.de/>

m0Da11 - Model-Oriented Data Analysis And Optimum Design,

12.06.-17.06. 2016, Hamminkeln-Dingden

Organisation: Ch. H. Müller (B5) und J. Kunert (C2).

<http://www.statistik.tu-dortmund.de/m0Da11/>

6th Workshop on New Developments in Econometrics and Time Series

22.09.-23.09.2016, Madrid, Spanien.

Organisation für den SFB 823: H. Dette (A1, C1, C2) et al.

Diskussionspapiere

- 42/15: F. Herrmann (A4): Evaluating the interplay of term premia, monetary policy, and the economy in the euro area.
- 41/15 Y. Hoga und D. Wied (A1): Sequential monitoring of the tail behavior of dependent data.
- 40/15 H. Dette und K. Schorning (alle C2): Optimal designs for comparing curves.
- 39/15 M. Frondel (A3), S. Sommer und C. Vance: Heterogeneity in residential electricity consumption: A quantile regression approach.
- 38/15 K. Kraft (A5): Productivity and distribution effects of codetermination in an efficient bargaining model.
- 37/15 D. Kobe und J. H. C. Woerner (alle C5): Oscillating Ornstein-Uhlenbeck processes and modelling of electricity prices.
- 36/15 A. Betken und M. Wendler (alle C3): Subsampling for general statistics under long range dependence.
- 35/15 B. Funke (C5): Nonparametric drift estimation in a Lévy driven diffusion model.
- 34/15 H. Dehling (C3), B. Franke und J. H. C. Woerner (C5): Estimating drift parameters in a fractional Ornstein Uhlenbeck Process with periodic mean.
- 33/15 J. Buchsteiner (C1): The sequential empirical process of nonlinear long-range dependent random vectors.
- 32/15 P. N. Posch, D. Ullmann und D. Wied (A1): Testing for structural changes in large portfolios.
- 31/15 W. Krämer (A1) und P. N. Posch: Partial orderings of default predictions.
- 30/15 S. Hermann, K. Ickstadt und Ch. H. Müller (alle B5): Bayesian prediction for a jump diffusion process with application to crack growth in fatigue experiments.
- 29/15 K. Pape (A1), D. Wied (A1) und P. Galeano: Monitoring multivariate variance changes.
- 28/15 F. Dunker (C4), S. Hoderlein und H. Kaido: Nonparametric identification of endogenous and heterogeneous aggregate demand models: Complements, bundles and the market level.
- 27/15 S. Sengupta, S. Volgushev (C1) und X. Shao: A subsampled double bootstrap for massive data.
- 26/15 K. Bissantz, N. Bissantz (C4) und K. Proksch (C4): Monitoring of significant changes over time in fluorescence microscopy imaging of living cells.
- 25/15 G. Heeke, S. Hermann, J. Heinrich, K. Ickstadt, R. Maurer und Ch. H. Müller (alle B5): Stochastic modeling and statistical analysis of fatigue tests on prestressed concrete beams under cyclic loadings.

- 24/15 M. Frondel (A3), C. Vance und A. Kihm: Time lags in the pass-through of crude-oil prices: Big data evidence from the German gasoline market.
- 23/15 H. Dette (C1, C2), R. Guchenko und V. B. Melas: Efficient computation of Bayesian optimal discriminating designs.
- 22/15 K. Dyballa und K. Kraft (alle A5): Does codetermination affect the composition of variable versus fixed parts of executive compensation? - An empirical analysis for listed companies in Germany.
- 21/15 K. Schorning (C1, C2), B. Bornkamp, F. Bretz und H. Dette (C1, C2): Model selection versus model averaging in dose finding studies.
- 20/15 P. Kinsvater, R. Fried und J. Lilienthal (alle B6): Regional extreme value index estimation and a test of homogeneity.
- 19/15 M. A. Andor (A3), M. Frondel (A3) und S. Sommer: Reforming the EU emissions trading system: An alternative to the market stability reserve.
- 18/15 M. Hoffmann (A1) und M. Vetter: Weak convergence of the empirical truncated distribution function of the Lévy measure of an Ito semimartingale.
- 17/15 W. Krämer und D. Wied (alle A1): A simple and focused backtest of value at risk.
- 16/15 H. Dehling, R. Fried und M. Wendler (alle C3): A robust method for shift detection in time series.
- 15/15 O. Sh. Sharipov, J. Tewes (C3) und M. Wendler (C3): Bootstrap for U-Statistics: A new approach.
- 14/15 H. Dette (A1, C1), K. Möllenhoff, S. Volgushev (C1) und F. Bretz: Equivalence of dose response curves.
- 13/15 Ch. H. Müller (B5), S. Szugat (B5), N. Celik und B. R. Clarke: Influence functions of trimmed likelihood estimators for lifetime experiments.

Alle Diskussionspapiere zum Herunterladen unter:

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